

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19期(決算日2019年9月17日)

作成対象期間(2019年3月16日～2019年9月17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。
当ファンドは、2017年12月8日に信託期間を延長する約款変更を行い、2025年3月17日を信託期間終了日といたしました。
なお、当ファンドからスイッチング可能である野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型につきましては2020年3月16日に信託期間満了となりますのでご注意ください。
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2025年3月17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・ポ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・ポ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・ポンドー日本円クラス | 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・ポ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。 |
| | 野村マネー マザーファンド | 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 野村マネー マザーファンド | 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 | み 金 期 騰 落 中 率 | | | | |
| | 円 | 円 | % | % | % | % | 百万円 |
| 15期(2017年9月15日) | 14,410 | 10 | 3.1 | 0.0 | — | 98.9 | 1,557 |
| 16期(2018年3月15日) | 14,297 | 10 | △0.7 | 0.0 | — | 99.1 | 1,340 |
| 17期(2018年9月18日) | 14,081 | 10 | △1.4 | 0.0 | — | 98.6 | 1,194 |
| 18期(2019年3月15日) | 14,189 | 10 | 0.8 | 0.1 | — | 99.0 | 1,083 |
| 19期(2019年9月17日) | 14,570 | 10 | 2.8 | 0.1 | — | 97.5 | 1,099 |

* 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 | | | |
| (期 首) | 円 | | % | % | % | % |
| 2019年3月15日 | 14,189 | — | — | 0.1 | — | 99.0 |
| 3月末 | 14,231 | | 0.3 | 0.1 | — | 99.0 |
| 4月末 | 14,352 | | 1.1 | 0.1 | — | 99.0 |
| 5月末 | 14,246 | | 0.4 | 0.1 | — | 98.9 |
| 6月末 | 14,469 | | 2.0 | 0.1 | — | 98.9 |
| 7月末 | 14,548 | | 2.5 | 0.1 | — | 98.6 |
| 8月末 | 14,532 | | 2.4 | 0.0 | — | 98.9 |
| (期 末) | | | | | | |
| 2019年9月17日 | 14,580 | | 2.8 | 0.1 | — | 97.5 |

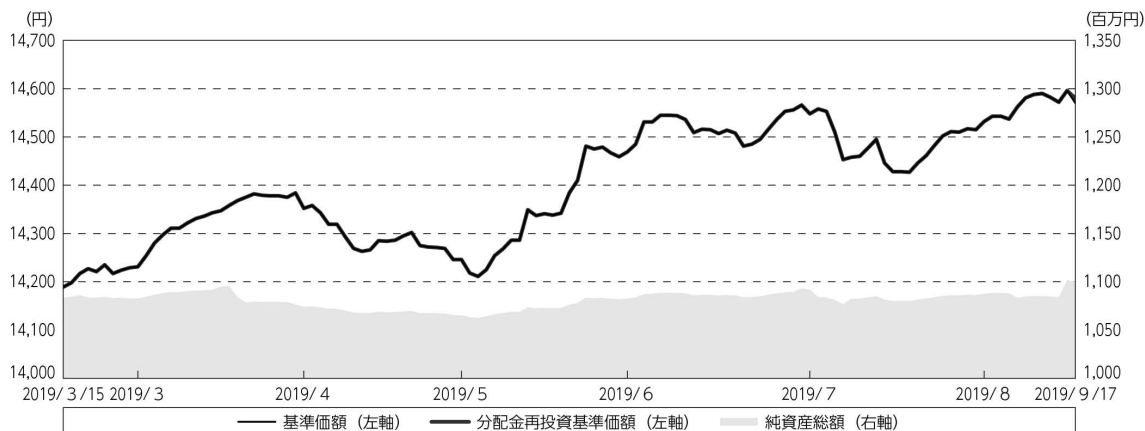
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 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：14,189円

期 末：14,570円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率： 2.8%（分配金再投資ベース）

（注）分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2019年3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す。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々の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

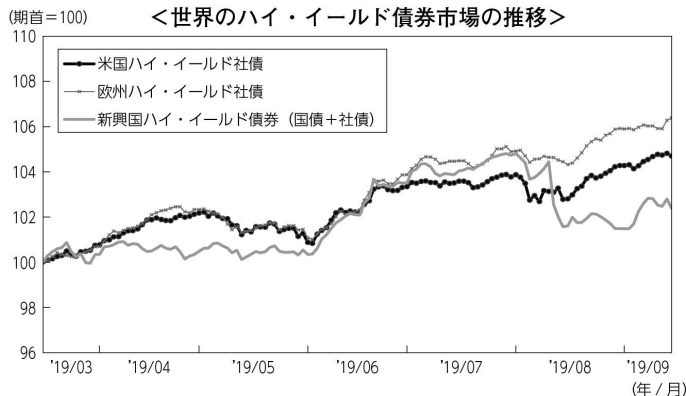
基準価額は、期首14,189円から期末には14,570円となりました。

- ・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：ICE BofAML US High Yield Constrained Index、欧州ハイ・イールド社債：ICE BofAML Euro High Yield Constrained Index、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々リバランスしたと仮定し算出。

<米国ハイ・イールド債券市場>

FRB（米連邦準備制度理事会）が2019年の利上げを想定しないなど緩和的な方針転換を鮮明にしたことや、米景気減速への懸念が和らいだことなどから、4月にかけて上昇しました。5月には、米国による中国製品への関税率引き上げに対し中国が報復措置を表明したことなどをを受けて軟調な展開となりましたが、その後は、米中通商協議進展への期待や、FRBによる利下げ観測の高まりなどを背景に概ね堅調に推移し、当作成期間において値上がりとなりました。

<欧州ハイ・イールド債券市場>

ドラギECB（欧州中央銀行）総裁が利上げ時期を先送りする方針を示したことや、英国の「合意なき離脱」が当面回避されたことなどから、4月にかけて上昇しました。5月には、ユーロ圏の経済減速が懸念されたことや、米中による関税引き上げ合戦が警戒されたことなどから下落する場面もありましたが、その後は、米中貿易協議進展への期待が高まったことや、ECBが利下げを示唆したことなどから堅調に推移し、当作成期間において値上がりとなりました。

＜新興国ハイ・イールド債券市場＞

世界的な景気減速が懸念された一方で、FRBの緩和的な方針転換が好感されたことなどから、5月にかけてほぼ横ばいの展開となりましたが、その後は、アルゼンチンの大統領選挙に向けた政治的不透明感が後退したことや、欧米の金融緩和期待が高まったこと、米中貿易摩擦への警戒感が和らいだことなどから堅調に推移しました。8月、米中对立の長期化による世界景気の先行き懸念を背景に投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから下落しましたが、当作成期間において値上がりとなりました。

- ICE BofAML US High Yield Constrained Indexは、ICE Data Indices, LLC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。
- ICE BofAML Euro High Yield Constrained Indexは、ICE Data Indices, LLC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、AAA格0.1%、AA格0.4%、A格3.0%、BBB格11.8%、BB格31.4%、B格32.0%、CCC格以下および無格付11.1%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。

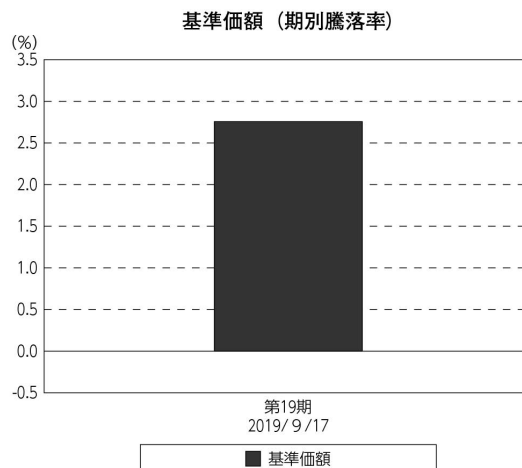
[野村マネー マザーファンド]

残存1年以内の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19期 |
|-----------|---------------------------|
| | 2019年3月16日～ 2019年9月17日 |
| 当期分配金 | 10 |
| (対基準価額比率) | 0.069% |
| 当期の収益 | 10 |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 11,240 |

(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1年以内の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って運用いたします。

日本銀行によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご留意ください。

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。

※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うけ、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

(2019年3月16日～2019年9月17日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|---------|------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 62 | % 0.428 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (22) | (0.151) | 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 ） | (38) | (0.263) | 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) | (0.014) | 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 | 62 | 0.429 | |
| 期中の平均基準価額は、14,396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。

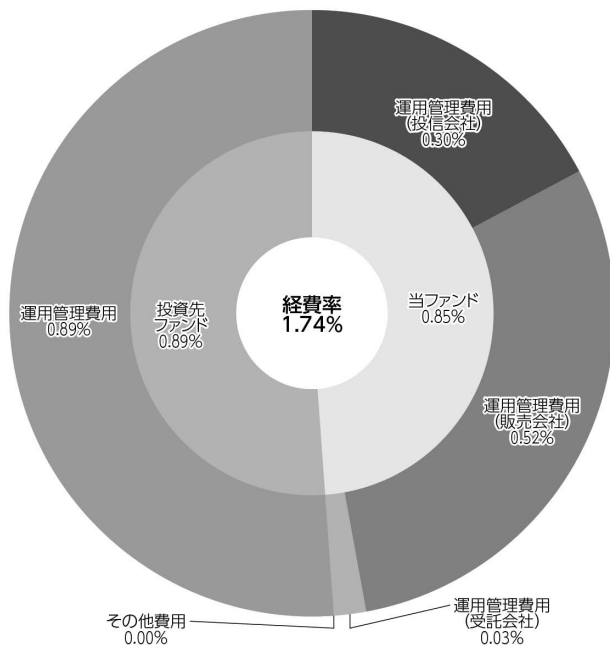
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

* 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。

（参考情報）

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は1.74%です。



(単位：%)

| | |
|--------------------|------|
| 経費率 (①+②) | 1.74 |
| ①当ファンドの費用の比率 | 0.85 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.89 |

(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2019年3月16日～2019年9月17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 | 4,500 | 26,098千円 | 4,663 | 27,181千円 |

*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

(2019年3月16日～2019年9月17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 10,446 | 百万円 700 | % 6.7 | 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

(2019年9月17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 | 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 | 184,646 | 184,483 | 1,072,215 | 97.5% |
| 合 計 | 184,646 | 184,483 | 1,072,215 | 97.5% |

*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 |
| | | 千口 | 千口 | 千円 |
| 野村マネー | マザーファンド | 984 | 984 | 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

(2019年9月17日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|---------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託受益証券 | 1,072,215 | 97.0 |
| 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 | 32,095 | 2.9 |
| 投資信託財産総額 | 1,105,315 | 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（2019年9月17日現在）

○損益の状況（2019年3月16日～2019年9月17日）

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 1,105,315,992 |
| コール・ローン等 | 32,095,773 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 1,072,215,196 |
| 野村マネー マザーファンド(評価額) | 1,005,023 |
| (B) 負債 | 5,407,340 |
| 未払収益分配金 | 754,915 |
| 未払信託報酬 | 4,640,519 |
| 未払利息 | 54 |
| その他未払費用 | 11,852 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,099,908,652 |
| 元本 | 754,915,958 |
| 次期繰越損益金 | 344,992,694 |
| (D) 受益権総口数 | 754,915,958口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 14,570円 |

(注) 期首元本額は763,503,121円、期中追加設定元本額は21,116,165円、期中一部解約元本額は29,703,328円、1口当たり純資産額は1,4570円です。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 32,550,248 |
| 受取配当金 | 32,554,949 |
| 支払利息 | △ 4,701 |
| (B) 有価証券売買損益 | 808,343 |
| 売買益 | 1,060,805 |
| 売買損 | △ 252,462 |
| (C) 信託報酬等 | △ 4,652,371 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 28,706,220 |
| (E) 前期繰越損益金 | 60,276,646 |
| (F) 追加信託差損益金 | 256,764,743 |
| (配当等相当額) | (585,158,356) |
| (売買損益相当額) | (△328,393,613) |
| (G) 計(D+E+F) | 345,747,609 |
| (H) 収益分配金 | △ 754,915 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 344,992,694 |
| 追加信託差損益金 | 256,764,743 |
| (配当等相当額) | (585,158,360) |
| (売買損益相当額) | (△328,393,617) |
| 分配準備積立金 | 263,441,454 |
| 繰越損益金 | △175,213,503 |

*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（2019年3月16日～2019年9月17日）は以下の通りです。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|---------------------------|
| | 2019年3月16日～ 2019年9月17日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 28,012,895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 | 585,158,360円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 236,183,474円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 849,354,729円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 11,250円 |
| g. 分配金 | 754,915円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 10円 |

○分配金のお知らせ

| | |
|-----------------|-----|
| 1 万円当たり分配金（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

（2019年9月17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（8,291,521千口）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 | 1,346,000 (1,346,000) | 1,348,003 (1,348,003) | 15.9 (15.9) | — (—) | — (—) | — (—) | 15.9 (15.9) | |
| 特殊債券 (除く金融債) | 2,010,000 (2,010,000) | 2,011,824 (2,011,824) | 23.8 (23.8) | — (—) | — (—) | — (—) | 23.8 (23.8) | |
| 金融債券 | 500,000 (500,000) | 500,216 (500,216) | 5.9 (5.9) | — (—) | — (—) | — (—) | 5.9 (5.9) | |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 2,700,000 (2,700,000) | 2,702,599 (2,702,599) | 31.9 (31.9) | — (—) | — (—) | — (—) | 31.9 (31.9) | |
| 合 計 | 6,556,000 (6,556,000) | 6,562,644 (6,562,644) | 77.6 (77.6) | — (—) | — (—) | — (—) | 77.6 (77.6) | |

*（ ）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 | 当 期 | 末 | | |
|------------------------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 神奈川県 公募第169回 | 1.43 | 90,000 | 90,327 | 2019/12/20 |
| 大阪府 公募第330回 | 1.48 | 116,000 | 116,044 | 2019/9/27 |
| 大阪府 公募第331回 | 1.41 | 100,000 | 100,160 | 2019/10/29 |
| 兵庫県 公募平成21年度第23回 | 1.37 | 100,000 | 100,114 | 2019/10/18 |
| 静岡県 公募平成21年度第5回 | 1.35 | 100,000 | 100,117 | 2019/10/18 |
| 広島県 公募平成21年度第3回 | 1.41 | 140,000 | 140,051 | 2019/9/25 |
| 福岡県 公募平成26年度第4回 | 0.135 | 100,000 | 100,007 | 2019/9/26 |
| 岐阜県 公募平成21年度第1回 | 1.35 | 100,000 | 100,151 | 2019/10/28 |
| 共同発行市場地方債 公募第79回 | 1.34 | 100,000 | 100,142 | 2019/10/25 |
| 広島市 公募平成21年度第2回 | 1.35 | 100,000 | 100,157 | 2019/10/29 |
| さいたま市 公募第7回 | 1.34 | 200,000 | 200,705 | 2019/12/25 |
| 鹿児島県 公募（5年）平成26年度第1回 | 0.153 | 100,000 | 100,023 | 2019/10/31 |
| 小 計 | | 1,346,000 | 1,348,003 | |
| 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46回 | 0.219 | 100,000 | 100,004 | 2019/9/20 |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第67回 | 0.001 | 100,000 | 100,000 | 2019/9/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第53回 | 1.38 | 400,000 | 400,048 | 2019/9/20 |
| 地方公共団体金融機構債券 第6回 | 1.518 | 460,000 | 461,335 | 2019/11/28 |
| 首都高速道路 第14回 | 0.273 | 420,000 | 420,298 | 2019/12/20 |
| 阪神高速道路 第15回 | 0.01 | 200,000 | 200,012 | 2019/12/20 |
| 国際協力銀行債券 第16回財投機関債 | 2.07 | 100,000 | 100,016 | 2019/9/20 |
| 中日本高速道路社債 第58回 | 0.182 | 230,000 | 230,108 | 2019/12/20 |
| 小 計 | | 2,010,000 | 2,011,824 | |
| 金融債券 | | | | |
| 農林債券 利付第773回い号 | 0.24 | 300,000 | 300,082 | 2019/10/25 |
| 農林債券 利付第775回い号 | 0.23 | 200,000 | 200,134 | 2019/12/27 |
| 小 計 | | 500,000 | 500,216 | |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | | | |
| 中部電力 第492回 | 1.405 | 350,000 | 350,507 | 2019/10/25 |
| 東北電力 第452回 | 1.405 | 100,000 | 100,380 | 2019/12/25 |
| 九州電力 第423回 | 0.959 | 100,000 | 100,021 | 2019/9/25 |
| 北海道電力 第319回 | 0.514 | 550,000 | 550,077 | 2019/9/25 |
| 三菱東京UFJ銀行 第110回特定社債間限定同順位特約付 | 1.485 | 400,000 | 400,465 | 2019/10/16 |
| 日立キャピタル 第45回社債間限定同順位特約付 | 0.666 | 100,000 | 100,159 | 2019/12/20 |
| 三菱UFJリース 第26回社債間限定同順位特約付 | 0.441 | 200,000 | 200,159 | 2019/11/21 |
| 三井不動産 第37回社債間限定同順位特約付 | 1.493 | 100,000 | 100,371 | 2019/12/20 |
| 東京急行電鉄 第69回社債間限定同順位特約付 | 1.7 | 200,000 | 200,339 | 2019/10/25 |
| 東海旅客鉄道 第16回社債間限定同順位特約付 | 1.875 | 600,000 | 600,117 | 2019/9/20 |
| 小 計 | | 2,700,000 | 2,702,599 | |
| 合 計 | | 6,556,000 | 6,562,644 | |

* 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 699,994 | % 8.3 |

*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

2018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" data-bbox="321 491 1066 538"> <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" data-bbox="321 783 1254 938"> <tbody> <tr> <td>円クラス</td> <td>外貨建資産を原則として対円で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で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で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 | | | | | | | | | | | | | | | |

※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。

「副投資顧問会社は、米国1940年投資顧問法規則第206条(4)項2号(「カस्ट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副投資顧問会社が任命した「独立した代理人」に対し、米国法で求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。

副投資顧問会社は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。アーサー・ベル社はCohen & Company(「コーヘン社」)と合併したため、コーヘン社が当ファンドの独立した代理人として従事します。

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、コーヘン社の「独立した代理人」としての地位は失われず、また、報酬を含めコーヘン社に不利益な契約変更は行われません。」

純資産計算書
2018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 | | 788,367,166 |
| <i>(取得原価：832,487,099米ドル)</i> | | |
| 現金預金等 | | 77,425,263 |
| クレジット・デフォルト・スワップ契約に係る評価差益 | | 269,136 |
| デリバティブに係る委託証拠金 | | 393,427 |
| ブローカーからの未収金 | | 2,667,002 |
| 未収収益 | | 12,986,918 |
| 現金及び現金等価物に係る利息 | | 2,532 |
| | | |
| 資産合計 | | 882,111,444 |
| 負債 | | |
| 銀行借越金 | | 23 |
| 先物契約に係る評価差損 | | 115,254 |
| 外国為替先渡し契約に係る評価差損 | | 15,606,265 |
| 受益証券買戻支払金 | | 333,567 |
| ブローカーへの未払金 | | 4,447,745 |
| 未払費用 | | 2,259,181 |
| | | |
| 負債合計 | | 22,762,035 |
| 純資産総額 | | 859,349,409 |

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 |
|-------------|--------------|------------|----------------|
| 日本円クラス(円) | 5,955 | 1,851,415 | 11,025,114,838 |
| アジア通貨クラス(円) | 4,061 | 2,825,826 | 11,476,788,493 |
| 資源国通貨クラス(円) | 2,453 | 29,581,296 | 72,563,657,646 |

運用計算書
2018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 | 1,216,173 |
| 債券利息(源泉徴収税控除後) | 52,753,224 |
| 受取配当金等(源泉徴収税控除後) | 929,535 |
| 雑収益 | 90,755 |
| | <hr/> |
| 収益合計 | 54,989,687 |
| | <hr/> |
| 費用 | |
| 投資顧問報酬 | 7,820,130 |
| 事務管理代行報酬 | 869,090 |
| 保管費用 | 283,469 |
| 当座借越利息 | 18,103 |
| 取引銀行報酬 | 85,909 |
| 銀行手数料 | 52,770 |
| 受託報酬 | 204,681 |
| 法務報酬 | 3,509 |
| 立替費用 | 102,224 |
| 専門家報酬 | 100,393 |
| 印刷、出版手数料 | 5,962 |
| 雑費用 | 729 |
| | <hr/> |
| 費用合計 | 9,546,969 |
| | <hr/> |
| 純投資損益 | 45,442,718 |
| | <hr/> |
| 投資有価証券売買に係る損益 | 13,596,011 |
| 先物契約に係る損益 | 955,658 |
| 外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益 | (14,089,584) |
| クレジット・デフォルト・スワップ契約に係る損益 | (485,062) |
| | <hr/> |
| 当期実現純損益 | (22,977) |
| | <hr/> |
| 投資有価証券評価損益の増減 | (43,543,177) |
| 先物契約に係る評価損益の増減 | (406,701) |
| 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 | 363,096 |
| 外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減 | (12,477,437) |
| | <hr/> |
| 当期評価差損益 | (56,064,219) |
| | <hr/> |
| 運用の結果による純資産の増減額 | (10,644,478) |
| | <hr/> |

純資産変動計算書
2018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 | 1,091,880,894 |
| 純投資損益 | 45,442,718 |
| 当期実現純損益 | (22,978) |
| 当期評価差損益 | (56,064,218) |
| 運用の結果による純資産の増減額 | (10,644,478) |
| 受益証券の発行手取金 | 36,632,558 |
| 受益証券の買戻支払金 | (134,614,509) |
| | (97,981,951) |
| 受益者への支払分配金 | (123,905,056) |
| 期末純資産総額 | 859,349,409 |

発行済受益証券数の変動表
2018年6月30日に終了する計測期間
(未監査)

| | | |
|----------|--|-------------|
| 日本円クラス | | |
| 期首受益証券数 | | 2,243,980 |
| 発行受益証券数 | | 56,437 |
| 買戻受益証券数 | | (449,002) |
| | | 1,851,415 |
| | | 1,851,415 |
| アジア通貨クラス | | |
| 期首受益証券数 | | 2,883,507 |
| 発行受益証券数 | | 164,252 |
| 買戻受益証券数 | | (221,933) |
| | | 2,825,826 |
| | | 2,825,826 |
| 資源国通貨クラス | | |
| 期首受益証券数 | | 32,457,305 |
| 発行受益証券数 | | 1,036,307 |
| 買戻受益証券数 | | (3,912,316) |
| | | 29,581,296 |
| | | 29,581,296 |

統計情報
2018年6月30日現在
(未監査)

| | 2018 | 2017 | 2016 |
|--------------|----------------|----------------|----------------|
| 期末純資産総額(米ドル) | 859,349,409 | 1,091,880,894 | 1,270,079,738 |
| 日本円クラス(円) | | | |
| 期末純資産総額 | 11,025,114,838 | 14,426,140,775 | 16,410,367,505 |
| 期末1口当たり純資産価格 | 5,955 | 6,429 | 6,410 |
| アジア通貨クラス(円) | | | |
| 期末純資産総額 | 11,476,788,493 | 13,334,342,252 | 15,490,451,241 |
| 期末1口当たり純資産価格 | 4,061 | 4,624 | 4,243 |
| 資源国通貨クラス(円) | | | |
| 期末純資産総額 | 72,563,657,646 | 94,601,239,993 | 98,536,423,706 |
| 期末1口当たり純資産価格 | 2,453 | 2,915 | 2,534 |

組入資産明細
2018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 | 389,000 | ANGOLA REP OF 8.2500% 09/05/28 REGS | 388,949 | 389,973 | 0.05 |
| USD | 270,000 | ANGOLA REP OF 9.3750% 08/05/48 REGS | 292,275 | 272,700 | 0.03 |
| | | | 681,224 | 662,673 | 0.08 |
| | | 合計：アンゴラ | 681,224 | 662,673 | 0.08 |
| アルゼンチン | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 3,062,000 | ARGENTINA 5.8750% 11/01/28 | 2,792,963 | 2,518,496 | 0.30 |
| USD | 1,576,000 | ARGENTINA 6.8750% 11/01/48 | 1,543,230 | 1,201,700 | 0.15 |
| USD | 435,000 | ARGENTINA 7.1250% 06/07/36 | 456,446 | 352,350 | 0.04 |
| USD | 287,000 | REP OF ARGENTINA 6.875% 22/04/21 | 297,025 | 286,641 | 0.03 |
| USD | 350,000 | REP OF ARGENTINA 7.625% 22/04/46 | 384,265 | 286,125 | 0.03 |
| USD | 304,000 | REP OF ARGENTINA 7.5% 22/04/26 | 317,771 | 283,480 | 0.03 |
| USD | 245,000 | PROV RIO NEGR 7.7500% 07/12/25 REGS | 245,000 | 189,875 | 0.02 |
| USD | 195,000 | PROV ENTRE RI 8.7500% 08/02/25 REGS | 210,698 | 171,469 | 0.02 |
| USD | 70,000 | REP OF ARGENTINA FRN 31/12/33 dis | 111,139 | 93,726 | 0.01 |
| | | | 6,358,537 | 5,383,862 | 0.63 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 650,000 | REP OF ARGENTINA FRN 31/12/33 | 975,573 | 833,863 | 0.10 |
| USD | 275,000 | PROVINCIA RIOS ARG 8.75% 08/02/25 | 291,024 | 241,817 | 0.03 |
| USD | 340,000 | REP OF ARGENTINA 2.5% 31/12/38 par | 235,747 | 194,650 | 0.02 |
| | | | 1,502,344 | 1,270,330 | 0.15 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 2,480,000 | YPF SOCIEDAD 6.9500% 21/07/27 REGS | 2,498,554 | 2,129,699 | 0.24 |
| USD | 1,900,000 | TRANSPORT DE 6.7500% 02/05/25 REGS | 1,894,775 | 1,738,500 | 0.19 |
| USD | 960,000 | YPF SOCIEDAD 8.5% 28/07/25 REGS | 1,082,093 | 908,640 | 0.11 |
| USD | 890,000 | RIO ENERGY SA 6.8750% 01/02/25 REGS | 881,413 | 743,150 | 0.09 |
| USD | 450,000 | GENNEIA SA 8.75% 20/01/22 REGS | 470,205 | 435,015 | 0.05 |
| USD | 200,000 | YPF SOCIEDAD 7.0000% 15/12/47 REGS | 200,000 | 151,400 | 0.02 |
| | | | 7,027,040 | 6,106,404 | 0.70 |
| | | 合計：アルゼンチン | 14,887,921 | 12,760,596 | 1.48 |
| オーストラリア | | | | | |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 2,175,000 | MIDWEST VANADIUM 11.5% 15/02/18 144 (2) | 2,065,898 | 2,535 | 0.00 |
| | | | 2,065,898 | 2,535 | 0.00 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 500,000 | CNOOC CURTIS 4.5% 03/10/23 REGS | 554,925 | 515,196 | 0.06 |
| | | | 554,925 | 515,196 | 0.06 |
| | | 合計：オーストラリア | 2,620,823 | 517,731 | 0.06 |
| オーストリア | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 1,000,000 | OMV AG FRN 29/12/49 | 1,058,990 | 1,389,804 | 0.16 |
| EUR | 600,000 | ERSTE GP BANK FRN 29/12/49 | 640,500 | 752,243 | 0.09 |
| | | | 1,699,490 | 2,142,047 | 0.25 |

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) | | | | | |
| EUR | 990,000 | SAPPI PAP HLD 3.375% 01/04/22 REGS | 1,053,536 | 1,165,302 | 0.14 |
| EUR | 400,000 | WIENERBERGER AG 2.0000% 02/05/24 | 487,459 | 474,079 | 0.06 |
| USD | 400,000 | JBS INVEST 7.25% 03/04/24 REGS | 419,800 | 386,004 | 0.04 |
| USD | 400,000 | JBS INVEST 7.25% 03/04/24 144A | 400,000 | 386,004 | 0.04 |
| USD | 200,000 | JBS INVEST 7.75% 28/10/20 REGS | 219,000 | 204,008 | 0.02 |
| | | | <u>2,579,795</u> | <u>2,615,397</u> | <u>0.30</u> |
| | | 合計：オーストリア | <u>4,279,285</u> | <u>4,757,444</u> | <u>0.55</u> |
| アゼルバイジャン | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 360,000 | STATE OIL CO 6.95% 18/03/30 | 374,234 | 384,300 | 0.04 |
| | | | <u>374,234</u> | <u>384,300</u> | <u>0.04</u> |
| | | 合計：アゼルバイジャン | <u>374,234</u> | <u>384,300</u> | <u>0.04</u> |
| バハマ | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 150,000 | SILVERSEA CRUISE 7.25% 01/02/25 144 | 150,000 | 162,000 | 0.02 |
| | | | <u>150,000</u> | <u>162,000</u> | <u>0.02</u> |
| | | 合計：バハマ | <u>150,000</u> | <u>162,000</u> | <u>0.02</u> |
| ベラルーシ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 610,000 | REP OF BELARU 6.2000% 28/02/30 REGS | 599,750 | 576,450 | 0.07 |
| USD | 410,000 | REP OF BELARUS 7.6250% 29/06/27 | 410,000 | 428,450 | 0.05 |
| USD | 320,000 | REP OF BELARUS 6.8750% 28/02/23 | 329,864 | 331,600 | 0.04 |
| | | | <u>1,339,614</u> | <u>1,336,500</u> | <u>0.16</u> |
| | | 合計：ベラルーシ | <u>1,339,614</u> | <u>1,336,500</u> | <u>0.16</u> |
| ベルギー | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 1,000,000 | KBC GROUP NV FRN 24/10/66 | 1,238,450 | 1,063,505 | 0.12 |
| EUR | 550,000 | KBC GROEP FRN 29/03/49 | 762,080 | 650,133 | 0.08 |
| EUR | 400,000 | BELFIUS BANK SA FRN 16/04/66 | 497,360 | 396,925 | 0.05 |
| | | | <u>2,497,890</u> | <u>2,110,563</u> | <u>0.25</u> |
| | | 合計：ベルギー | <u>2,497,890</u> | <u>2,110,563</u> | <u>0.25</u> |
| バミューダ諸島 | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 200,000 | SHENZHEN INTL FRN 29/05/67 | 190,400 | 187,504 | 0.02 |
| | | | <u>190,400</u> | <u>187,504</u> | <u>0.02</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,625,000 | DIGICEL GROUP 8.25% 30/09/20 REGS | 1,472,940 | 1,210,624 | 0.14 |
| USD | 1,200,000 | DIGICEL LTD 6.75% 01/03/23 144A | 1,186,145 | 996,000 | 0.12 |
| USD | 1,100,000 | DIGICEL LTD 8.25% 30/09/20 144A | 1,046,000 | 819,500 | 0.10 |
| USD | 870,000 | DIGICEL LTD 6% 15/04/21 REGS | 849,346 | 788,981 | 0.09 |
| USD | 1,080,000 | DIGICEL GP LTD 7.125% 01/04/22 REGS | 952,164 | 712,919 | 0.08 |
| USD | 600,000 | BANCO BRADESCO 5.9% 16/01/21 REGS | 618,589 | 612,816 | 0.07 |
| USD | 530,000 | CBQ FINANCE L 5.0000% 24/05/23 EMTN | 526,348 | 528,553 | 0.06 |
| USD | 325,000 | AIRCATTLE LTD 5.125% 15/03/21 | 325,000 | 329,875 | 0.04 |
| USD | 300,000 | DIGICEL LTD 6% 15/04/21 144A | 294,400 | 272,063 | 0.03 |
| USD | 250,000 | VIKING CRUISES LTD 6.25% 15/5/25 14 | 250,375 | 245,000 | 0.03 |
| USD | 175,000 | VIK CRUISES L 5.8750% 15/09/27 144A | 175,194 | 165,375 | 0.02 |
| USD | 50,000 | WEATHERFORD BERMUDA 8.25% 15/06/23 | 50,750 | 49,605 | 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 | 50,000 | WEATHERFORD BERMUDA 6.5% 01/08/36 | 40,750 | 39,125 | 0.00 |
| | | | 7,788,001 | 6,770,436 | 0.79 |
| | | 合計：パミューダ諸島 | 7,978,401 | 6,957,940 | 0.81 |
| | | ブラジル | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 947,000 | BRAZIL REP OF 4.6250% 13/01/28 | 883,018 | 853,268 | 0.10 |
| USD | 836,000 | REP OF BRAZIL 5% 27/01/45 | 760,474 | 662,530 | 0.08 |
| USD | 399,000 | FED REP OF BRAZIL 2.625% 05/01/23 | 369,528 | 362,591 | 0.04 |
| USD | 240,000 | FED REP OF BRAZIL 8.25% 20/01/34 | 309,941 | 276,000 | 0.03 |
| USD | 200,000 | FED REP OF BRAZIL 6% 07/04/26 | 210,000 | 205,500 | 0.02 |
| USD | 100,000 | FED REP OF BRAZIL 5.625% 07/01/41 | 93,777 | 87,625 | 0.01 |
| USD | 70,000 | FED REP OF BRAZIL 5.625% 21/02/47 | 67,316 | 59,763 | 0.01 |
| USD | 49,000 | REP OF BRAZIL 7.125% 20/01/37 | 49,358 | 51,940 | 0.01 |
| | | | 2,743,412 | 2,559,217 | 0.30 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,115,000 | BANCO BRASL (4.6250% 15/01/25 REGS | 1,092,372 | 1,027,204 | 0.12 |
| USD | 655,000 | VOTORANTIM CIMENTOS 7.25% 5/4/41 RE | 723,317 | 652,550 | 0.08 |
| USD | 520,000 | CEMIG GER TAN 9.2500% 05/12/24 REGS | 513,464 | 527,410 | 0.06 |
| USD | 200,000 | BANCO NAC DE DES 4.75% 09/05/24 REG | 199,412 | 187,500 | 0.02 |
| USD | 166,000 | BANCO NAC DE 6.5% 10/06/19 REGS | 180,760 | 170,358 | 0.02 |
| | | | 2,709,325 | 2,565,022 | 0.30 |
| | | 合計：ブラジル | 5,452,737 | 5,124,239 | 0.60 |
| | | 英領ヴァージン諸島 | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 200,000 | CHALCO HK INVEST FRN 29/12/49 | 194,500 | 191,084 | 0.02 |
| | | | 194,500 | 191,084 | 0.02 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 4,258,000 | QGOG ATLANTIC 5.25% 30/07/18 REGS | 341,488 | 335,540 | 0.04 |
| | | | 341,488 | 335,540 | 0.04 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,600,000 | SINOPEC 2013 4.375% 17/10/23 144A | 1,710,240 | 1,638,553 | 0.18 |
| USD | 1,400,000 | SINOPEC 3.125% 24/04/23 REGS | 1,376,636 | 1,352,735 | 0.16 |
| USD | 1,300,000 | CNOOC 3% 09/05/23 | 1,286,519 | 1,253,371 | 0.15 |
| USD | 1,200,000 | HUARONG FINANCE 2017 4.75% 27/04/27 | 1,196,508 | 1,153,674 | 0.13 |
| USD | 1,126,000 | SINOCEM OVS 4.5% 12/11/20 | 1,199,902 | 1,145,036 | 0.13 |
| USD | 1,000,000 | STATE GRID 4.125% 07/05/24 REGS | 1,069,170 | 1,015,070 | 0.12 |
| USD | 620,000 | FRANSHION DEV 6.75% 15/04/21 REGS | 690,101 | 657,786 | 0.08 |
| USD | 700,000 | GERDAU TRADE 4.8750% 24/10/27 REGS | 693,182 | 645,750 | 0.08 |
| USD | 600,000 | SINOPEC GRP OVERS 3.9% 17/05/22 144 | 614,400 | 603,841 | 0.07 |
| USD | 500,000 | CHINA CINDA FIN 4% 14/05/19 REGS | 511,675 | 501,505 | 0.06 |
| USD | 500,000 | CNPC GENERAL CAP 3.4% 16/04/23 REGS | 507,175 | 491,934 | 0.06 |
| USD | 500,000 | CHINA CINDA FIN 4.25% 23/04/25 REG | 478,180 | 487,425 | 0.06 |
| USD | 350,000 | STATE GRID 3.5% 04/05/27 REGS | 357,431 | 334,218 | 0.04 |
| USD | 300,000 | HUARONG FINANCE 5.5% 16/01/25 EMTN | 314,284 | 307,770 | 0.04 |
| USD | 200,000 | GTL TRADE FIN 7.2500% 16/04/44 REGS | 208,500 | 202,500 | 0.02 |
| USD | 150,000 | GTL TRADE FIN 5.893% 29/04/24 REGS | 161,550 | 151,086 | 0.02 |
| USD | 100,000 | SINOCEM OVS 6.3% 12/11/40 | 125,852 | 123,275 | 0.01 |
| USD | 100,000 | SINOPEC GRP OVERS 4.875% 17/5/42 RE | 109,080 | 104,428 | 0.01 |
| | | | 12,610,385 | 12,169,957 | 1.42 |
| | | 合計：英領ヴァージン諸島 | 13,146,373 | 12,696,581 | 1.48 |

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(%) |
|-------------------------|----------------------------|--------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| カナダ | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 125,000 | BANK NOVA SCOTIA FRN 12/04/66 | 125,000 | 113,281 | 0.01 |
| | | | 125,000 | 113,281 | 0.01 |
| 普通株式 | | | | | |
| — | 2,179,273 | CATALYST PAPER C | 46,951 | 16,483 | 0.00 |
| | | | 46,951 | 16,483 | 0.00 |
| ベイ・イン・カインド(PIK)債 | | | | | |
| USD | 110,938 | XPLORNET COMM PIK 9.625% 1/6/22 144 | 100,000 | 115,375 | 0.01 |
| USD | 439,762 | ALBERTA /ALGOMA PIK 14% 13/02/20 (2) | 365,544 | 2,199 | 0.00 |
| | | | 465,544 | 117,574 | 0.01 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,300,000 | VALEANT PHARM 9.0000% 15/12/25 144A | 1,302,896 | 1,348,749 | 0.16 |
| USD | 1,310,000 | VRX ESCROW 6.125% 15/4/25 144A | 1,101,637 | 1,206,837 | 0.14 |
| USD | 1,175,000 | GARDA WORLD SEC 7.25% 15/11/21 144A | 1,188,187 | 1,174,999 | 0.14 |
| USD | 1,000,000 | FIRST QUANTUM 6.5000% 01/03/24 144A | 989,749 | 957,499 | 0.11 |
| EUR | 720,000 | COTT FINANCE 5.5% 01/07/24 REGS | 811,223 | 877,861 | 0.10 |
| USD | 925,000 | 1011778 BC UL 5.0000% 15/10/25 144A | 928,562 | 876,437 | 0.10 |
| USD | 800,000 | FIRST QUANTUM MIN 7.25% 01/04/23 14 | 798,676 | 797,999 | 0.09 |
| USD | 800,000 | FIRST QUANTUM 6.8750% 01/03/26 144A | 800,000 | 767,999 | 0.09 |
| USD | 675,000 | TECK RESOURCES LTD 6.125% 01/10/35 | 569,217 | 680,063 | 0.08 |
| USD | 700,000 | MEG ENERGY CORP 6.375% 30/1/23 144A | 668,954 | 651,000 | 0.08 |
| USD | 650,000 | 1011778 BC/NEWRED 4.625% 15/01/22 1 | 650,210 | 648,375 | 0.08 |
| USD | 625,000 | BROOKFIELD RESID 6.375% 15/5/25 144 | 639,288 | 618,750 | 0.07 |
| USD | 575,000 | VPI ESCROW CORP 7.5% 15/07/21 144A | 534,330 | 585,422 | 0.07 |
| USD | 550,000 | GW HONOS SEC 8.75% 15/05/25 144A | 546,029 | 562,375 | 0.07 |
| EUR | 500,000 | VRX ESCROW 4.5% 15/05/23 REGS | 512,005 | 548,978 | 0.06 |
| USD | 545,000 | BOMBARDIER INC 6% 15/10/22 144A | 507,478 | 542,275 | 0.06 |
| USD | 475,000 | KISSNER GR HDG 8.375% 01/12/22 144A | 482,500 | 485,688 | 0.06 |
| USD | 475,000 | TASEKO MINES 8.7500% 15/06/22 144A | 470,250 | 484,500 | 0.06 |
| USD | 480,000 | TRINIDAD DRIL 6.625% 15/02/25 144A | 484,675 | 462,000 | 0.05 |
| USD | 460,000 | VRX ESCROW 5.875% 15/05/23 144A | 383,581 | 431,250 | 0.05 |
| USD | 425,000 | BOMBARDIER INC 6.125% 15/01/23 144A | 398,063 | 426,063 | 0.05 |
| USD | 425,000 | CASCADES INC 5.75% 15/07/23 144A | 425,000 | 418,625 | 0.05 |
| USD | 390,000 | BOMBARDIER INC 7.5% 15/03/25 144A | 372,249 | 406,088 | 0.05 |
| USD | 375,000 | PARAMOUNT RES 6.875% 30/06/23 144A | 373,249 | 386,719 | 0.05 |
| USD | 375,000 | OPEN TEXT CORP 5.875% 01/06/26 144A | 375,000 | 382,500 | 0.04 |
| USD | 330,000 | MATTAMY GROUP 6.875% 15/12/23 144A | 340,975 | 334,488 | 0.04 |
| USD | 300,000 | AIR CANADA 7.75% 15/04/21 144A | 308,250 | 320,250 | 0.04 |
| USD | 300,000 | BOMBARDIER IN 7.5000% 01/12/24 144A | 300,000 | 315,750 | 0.04 |
| USD | 275,000 | PRECISION DRILL 7.7500% 15/12/23 WI | 290,438 | 289,438 | 0.03 |
| USD | 275,000 | COOKE/ALPHA 8.5000% 15/12/22 144A | 266,910 | 277,750 | 0.03 |
| USD | 250,000 | TECK RESOURCES LTD 4.75% 15/01/22 | 236,000 | 250,523 | 0.03 |
| USD | 230,000 | HUDBAY MINERALS 7.625% 15/01/25 14 | 248,966 | 240,925 | 0.03 |
| USD | 250,000 | TECK RESOURCES LTD 3.75% 01/02/23 | 243,750 | 237,188 | 0.03 |
| USD | 250,000 | MEG ENERGY CORP 7% 31/03/24 144A | 228,112 | 232,813 | 0.03 |
| USD | 225,000 | VERMILION EN 5.625% 15/03/25 144a | 225,307 | 222,750 | 0.03 |
| USD | 225,000 | NOVA CHEMICALS CORP 5.25% 01/06/27 | 225,000 | 210,375 | 0.02 |
| USD | 200,000 | PRECISION DRI 7.1250% 15/01/26 144A | 200,000 | 205,300 | 0.02 |
| USD | 200,000 | IAMGOLD CORP 7% 15/04/25 144A | 200,000 | 203,940 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ST MARYS CEMENT 5.75% 28/01/27 REGS | 197,060 | 192,750 | 0.02 |
| USD | 200,000 | PRECISION DRILLING 5.25% 15/11/24 | 200,000 | 189,000 | 0.02 |
| USD | 185,000 | TECH RESOURCES LTD 6.25% 15/07/41 | 186,096 | 184,538 | 0.02 |
| USD | 175,000 | KINROSS GOLD CORP 5.125% 01/09/21 | 181,125 | 179,541 | 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 | 190,000 | TITAN ACQ/CO- 7.7500% 15/04/26 144A | 190,825 | 177,175 | 0.02 |
| USD | 145,000 | HULK FINANCE 7.0000% 01/06/26 144A | 145,000 | 137,750 | 0.02 |
| USD | 135,000 | VALEANT PHARM 8.5000% 31/01/27 144A | 137,406 | 136,742 | 0.02 |
| USD | 140,000 | GFL ENVIRON I 5.3750% 01/03/23 144A | 140,000 | 129,500 | 0.02 |
| USD | 125,000 | ROCKPOINT GAS 7.0000% 31/03/23 144A | 121,710 | 125,000 | 0.01 |
| USD | 125,000 | NORTHWEST/DOM 7.1250% 01/11/22 144A | 123,704 | 124,688 | 0.01 |
| USD | 125,000 | SEVEN GENS EN 5.3750% 30/09/25 144A | 125,000 | 120,156 | 0.01 |
| USD | 100,000 | BOMBARDIER IN 7.7500% 15/03/20 144A | 110,000 | 105,500 | 0.01 |
| USD | 100,000 | NORBORD INC 6.25% 15/04/23 144A | 100,000 | 104,260 | 0.01 |
| USD | 100,000 | TECK RESOURCES LTD 4.5% 15/01/21 | 103,313 | 100,000 | 0.01 |
| USD | 100,000 | MOUNTAIN PROV 8.0000% 15/12/22 144A | 97,992 | 99,625 | 0.01 |
| USD | 1,150,000 | LIGHTSTREAM RESOUR 8.625% 1/2/20 14 (2) | 1,144,250 | 97,750 | 0.01 |
| USD | 95,000 | AUTOMATION TOOLING 6.5% 15/6/23 144 | 95,375 | 96,900 | 0.01 |
| USD | 90,000 | VALEANT PHARMA 7% 15/03/24 144A | 90,000 | 94,388 | 0.01 |
| USD | 75,000 | GOEASY LTD 7.8750% 01/11/22 144A | 75,000 | 79,313 | 0.01 |
| USD | 75,000 | PARKLAND FUEL 6.0000% 01/04/26 144A | 75,000 | 74,070 | 0.01 |
| USD | 75,000 | TECK RESOURCES LTD 6% 15/08/40 | 52,125 | 72,938 | 0.01 |
| USD | 75,000 | NOVA CHEMICALS CORP 5% 01/05/25 144 | 71,969 | 71,063 | 0.01 |
| USD | 65,000 | VALEANT PHARM 5.5000% 01/11/25 144A | 65,000 | 64,058 | 0.01 |
| USD | 50,000 | FIRST QUANTUM MIN 7% 15/02/21 144A | 50,500 | 50,500 | 0.01 |
| USD | 50,000 | CLEARWATER SEAFOOD 6.875% 1/5/25 14 | 50,000 | 48,000 | 0.01 |
| USD | 25,000 | TECK RESOURCES 5.2000% 01/03/42 | 25,438 | 21,906 | 0.00 |
| USD | 500,000 | SANJEL CORP 7.5% 19/06/19 (2) | 453,500 | 50 | 0.00 |
| | | | 24,034,104 | 22,947,702 | 2.68 |
| | | 合計：カナダ | 24,671,599 | 23,195,040 | 2.70 |
| | | ケイマン諸島 | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| GBP | 415,000 | SMFG PREF CAP FRN 29/07/49 REGS | 978,916 | 860,761 | 0.10 |
| USD | 420,000 | BANCO BRADESCO 9.25% 29/10/49 REGS | 404,775 | 414,750 | 0.05 |
| USD | 200,000 | QNB FINANCE LTD FRN 31/05/21 EMTN | 200,000 | 200,873 | 0.02 |
| | | | 1,583,691 | 1,476,384 | 0.17 |
| その他債券 | | | | | |
| GBP | 500,000 | MIZZEN BONDCO 7% 01/05/21 REGS | 819,523 | 630,238 | 0.07 |
| USD | 250,000 | LIMA METRO LINE 2 5.875% 5/7/34 REG | 250,000 | 252,940 | 0.03 |
| | | | 1,069,523 | 883,178 | 0.10 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,210,000 | VALE OVERSEAS 6.875% 21/11/36 | 1,183,004 | 1,358,467 | 0.17 |
| USD | 1,300,000 | ALIBABA GROUP 3.4000% 06/12/27 | 1,231,932 | 1,211,916 | 0.15 |
| USD | 1,200,000 | TENCENT HOLDI 3.5950% 19/01/28 REGS | 1,169,425 | 1,135,800 | 0.14 |
| USD | 1,240,000 | PETROBRAS INTL FIN 6.875% 20/01/40 | 1,150,259 | 1,125,300 | 0.14 |
| USD | 840,000 | VALE OVERSEAS 6.875% 10/11/39 | 858,153 | 947,100 | 0.11 |
| USD | 800,000 | HUTCH WHAMPOA 4.625% 13/01/22 REGS | 893,920 | 821,745 | 0.10 |
| USD | 800,000 | UPCB FINANCE IV 5.375% 15/1/25 144A | 799,000 | 756,000 | 0.09 |
| USD | 700,000 | CHINA OVERSEAS FIN 5.5% 10/11/20 RE | 761,126 | 728,023 | 0.08 |
| EUR | 600,000 | UPCB FINANCE IV 4% 15/01/27 REGS | 647,280 | 705,180 | 0.08 |
| USD | 550,000 | VALE OVERSEAS 8.2500% 17/01/34 | 731,495 | 686,125 | 0.08 |
| USD | 690,000 | YUZHOU PROPRTIE 6.3750% 06/03/21 | 691,725 | 671,024 | 0.08 |
| USD | 680,000 | SUNAC CHINA HLDG 7.9500% 08/08/22 | 697,680 | 637,409 | 0.07 |
| USD | 600,000 | SWIRE PACIFIC 4.5% 09/10/23 EMTN | 661,194 | 621,000 | 0.07 |
| USD | 640,000 | CHINA EVERGRANDE 7.5000% 28/06/23 | 637,760 | 571,903 | 0.07 |
| USD | 700,000 | GOL FINANCE 7.0000% 31/01/25 REGS | 690,228 | 561,400 | 0.07 |
| USD | 575,000 | NOBLE HDGS INTL 7.75% 15/01/24 | 547,800 | 544,813 | 0.06 |
| USD | 520,000 | SABLE INTL FIN 6.875% 01/08/22 144A | 518,787 | 542,386 | 0.06 |
| USD | 500,000 | COUNTRY GARDEN 7.25% 04/04/21 REGS | 476,875 | 502,740 | 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(%) |
|-------------|----------------------------|-------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------|
| USD | 504,000 | PARK AEROSPACE HDG 5.25% 15/08/22 | 509,457 | 498,960 | 0.06 |
| USD | 500,000 | LATAM FINANCE LTD 6.875% 11/04/24 R | 500,000 | 488,750 | 0.06 |
| USD | 480,000 | SHELF DRL HOL 8.2500% 15/02/25 144A | 483,269 | 483,600 | 0.06 |
| USD | 500,000 | MELCO RESORTS 4.8750% 06/06/25 REGS | 501,200 | 471,021 | 0.05 |
| USD | 500,000 | BANCO DO BRASIL 3.875% 10/10/22 | 397,340 | 466,250 | 0.05 |
| USD | 450,000 | NOBLE HLDG IN 7.8750% 01/02/26 144A | 451,569 | 463,500 | 0.05 |
| USD | 400,000 | TRANSOCEAN IN 7.5000% 15/01/26 144A | 408,543 | 407,000 | 0.05 |
| USD | 400,000 | CENTRAL CHINA REAL ES 8.75% 23/1/21 | 411,898 | 404,227 | 0.05 |
| USD | 400,000 | CIFI HOLDINGS 6.8750% 23/04/21 | 400,000 | 394,922 | 0.05 |
| USD | 400,000 | HUTCH WHAMPOA 3.625% 31/10/24 REGS | 407,688 | 393,535 | 0.05 |
| USD | 400,000 | WYNN MACAU LT 5.5000% 01/10/27 144A | 400,000 | 382,000 | 0.04 |
| USD | 312,000 | VALE OVERSEAS LTD 6.25% 10/08/26 | 343,630 | 338,910 | 0.04 |
| USD | 343,000 | AMBER CIRCLE FDING 3.25% 4/12/22 RE | 345,819 | 336,030 | 0.04 |
| USD | 300,000 | BCO BTG PACTUAL/CAYM 4% 16/1/20 REG | 278,550 | 291,450 | 0.03 |
| USD | 254,000 | VALE OVERSEAS 4.3750% 11/01/22 | 263,830 | 257,045 | 0.03 |
| USD | 200,000 | BRASKEM FINANCE 6.45% 03/02/24 | 224,898 | 209,200 | 0.02 |
| USD | 200,000 | BRASKEM FIN L 5.7500% 15/04/21 REGS | 208,040 | 206,502 | 0.02 |
| USD | 200,000 | MAF GLOBAL SECS 4.75% 07/05/24 REG | 199,670 | 202,334 | 0.02 |
| USD | 200,000 | EMG SUKUK 4.564% 18/06/24 | 199,180 | 198,900 | 0.02 |
| USD | 200,000 | BOS FUNDING LTD 3.3740% 08/06/20 | 197,040 | 196,600 | 0.02 |
| USD | 200,000 | PARK AEROSPAC 3.6250% 15/03/21 144A | 200,000 | 193,750 | 0.02 |
| USD | 200,000 | WYNN MACAU LT 4.8750% 01/10/24 144A | 200,000 | 190,940 | 0.02 |
| USD | 200,000 | LONGFOR PROPERTI 4.5000% 16/01/28 | 185,160 | 181,413 | 0.02 |
| USD | 125,000 | NOBLE HDGS INTL 6.95% 01/04/45 | 109,313 | 114,063 | 0.01 |
| USD | 100,000 | PARK AEROSPACE 5.5% 15/02/24 144A | 103,000 | 99,000 | 0.01 |
| USD | 100,000 | TRANSOCEAN INC 7.5% 15/04/31 | 90,500 | 92,750 | 0.01 |
| USD | 50,000 | NOBLE HDGS INTL 6.2% 01/08/40 | 36,875 | 36,000 | 0.00 |
| | | | <u>22,404,112</u> | <u>22,126,983</u> | <u>2.58</u> |
| | | 合計：ケイマン諸島 | <u>25,057,326</u> | <u>24,486,545</u> | <u>2.85</u> |
| | | チリ | | | |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 630,000 | EMPRESA ELECTRICA 4.875% 25/5/29 RE | 579,519 | 587,103 | 0.07 |
| | | | <u>579,519</u> | <u>587,103</u> | <u>0.07</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 707,000 | CODELCO INC 5.625% 18/10/43 REGS | 800,479 | 796,422 | 0.09 |
| USD | 800,000 | EMPRESA NACIONAL 3.75% 05/08/26 REG | 786,824 | 751,935 | 0.09 |
| USD | 600,000 | EMBOTELL ANDINA 5% 01/10/23 REGS | 648,600 | 620,735 | 0.07 |
| USD | 500,000 | CODELCO INC 4.5% 16/09/25 REGS | 501,833 | 511,662 | 0.06 |
| USD | 560,000 | EMPRESA NACIO 4.5000% 14/09/47 REGS | 543,928 | 500,640 | 0.06 |
| USD | 500,000 | CELULOSA ARAUCO 4.5000% 01/08/24 | 516,875 | 496,875 | 0.06 |
| USD | 370,000 | COLBUN SA 3.9500% 11/10/27 REGS | 368,971 | 345,210 | 0.04 |
| USD | 325,000 | CELULOSA ARAUCO 5.5000% 02/11/47 | 324,051 | 316,228 | 0.04 |
| USD | 330,000 | CELULOSA ARAUCO 3.8750% 02/11/27 | 324,944 | 306,075 | 0.04 |
| USD | 325,000 | SACI FALABELL 3.7500% 30/10/27 REGS | 321,659 | 299,488 | 0.03 |
| USD | 259,000 | CODELCO INC 4.5000% 01/08/47 REGS | 251,769 | 251,634 | 0.03 |
| USD | 250,000 | E. CL SA 4.5% 29/01/25 REGS | 259,375 | 248,505 | 0.03 |
| USD | 200,000 | CENCOSUD SA 6.625% 12/02/45 REGS | 212,750 | 201,726 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ENEL CHILE SA 4.8750% 12/06/28 | 200,250 | 201,500 | 0.02 |
| | | | <u>6,062,308</u> | <u>5,848,635</u> | <u>0.68</u> |
| | | 合計：チリ | <u>6,641,827</u> | <u>6,435,738</u> | <u>0.75</u> |
| | | 中国 | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 1,000,000 | CHINA CONSTRUCT BK FRN 13/05/25 | 1,005,685 | 993,082 | 0.12 |
| | | | <u>1,005,685</u> | <u>993,082</u> | <u>0.12</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(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------------|------------------|-------------|
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,200,000 | BANK OF CHINA 5% 13/11/24 REGS | 1,265,724 | 1,225,558 | 0.14 |
| USD | 910,000 | EXPORT IMPORT BK 3.625% 31/07/24 R | 981,754 | 898,307 | 0.10 |
| | | | <u>2,247,478</u> | <u>2,123,865</u> | <u>0.24</u> |
| | | 合計：中国 | <u>3,253,163</u> | <u>3,116,947</u> | <u>0.36</u> |
| コロンビア | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 300,000 | BANCOLOMBIA FRN 18/10/27 | 300,000 | 284,625 | 0.03 |
| | | | <u>300,000</u> | <u>284,625</u> | <u>0.03</u> |
| 国債 | | | | | |
| USD | 1,181,000 | REP OF COLOMBIA 5% 15/06/45 | 1,157,850 | 1,159,742 | 0.14 |
| USD | 742,000 | REP OF COLOMBIA 6.125% 18/01/41 | 839,433 | 827,297 | 0.10 |
| USD | 350,000 | REP OF COLOMBIA 5.625% 26/02/44 | 397,363 | 372,575 | 0.04 |
| USD | 56,000 | REP OF COLOMBIA 8.125% 21/05/24 | 68,432 | 67,384 | 0.01 |
| | | | <u>2,463,078</u> | <u>2,426,998</u> | <u>0.29</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,105,000 | ECOPETROL SA 5.875% 28/05/45 | 975,971 | 1,048,093 | 0.12 |
| USD | 530,000 | SURA ASSET MGNT 4.375% 11/04/27 REG | 525,092 | 506,150 | 0.06 |
| USD | 270,000 | BANCO DE BOGOTA 6.25% 12/05/26 REGS | 279,697 | 275,570 | 0.03 |
| | | | <u>1,780,760</u> | <u>1,829,813</u> | <u>0.21</u> |
| | | 合計：コロンビア | <u>4,543,838</u> | <u>4,541,436</u> | <u>0.53</u> |
| コスタリカ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 430,000 | REP OF COSTA RICA 7% 4/04/44 REGS | 447,200 | 417,638 | 0.05 |
| USD | 400,000 | REP OF COSTA RICA 7.158% 12/3/45 R | 400,000 | 396,000 | 0.05 |
| | | | <u>847,200</u> | <u>813,638</u> | <u>0.10</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 200,000 | BANCO NAL COSTA 6.25% 1/11/23 REGS | 199,400 | 204,384 | 0.02 |
| | | | <u>199,400</u> | <u>204,384</u> | <u>0.02</u> |
| | | 合計：コスタリカ | <u>1,046,600</u> | <u>1,018,022</u> | <u>0.12</u> |
| クロアチア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 210,000 | CROATIA GVT 6% 26/01/24 REGS | 218,925 | 226,050 | 0.03 |
| | | | <u>218,925</u> | <u>226,050</u> | <u>0.03</u> |
| | | 合計：クロアチア | <u>218,925</u> | <u>226,050</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 | 202,750 | 0.02 |
| | | | <u>200,000</u> | <u>202,750</u> | <u>0.02</u> |
| | | 合計：キプロス | <u>200,000</u> | <u>202,750</u> | <u>0.02</u> |
| チェコ共和国 | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 1,680,000 | RESIDOMO SRO 3.3750% 15/10/24 REGS | 1,964,000 | 1,942,901 | 0.23 |
| | | | <u>1,964,000</u> | <u>1,942,901</u> | <u>0.23</u> |
| | | 合計：チェコ共和国 | <u>1,964,000</u> | <u>1,942,901</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(%) |
|--------------------|----------------------------|--------------------------------------|------------|-----------|---------|
| デンマーク | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 600,000 | DANSKE BANK FRN 29/10/49 EMTN | 675,228 | 758,610 | 0.09 |
| | | | 675,228 | 758,610 | 0.09 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 430,000 | DKT FINANCE 7.0000% 17/06/23 REGS | 497,144 | 505,957 | 0.06 |
| EUR | 380,000 | NORICAN GROUP APS 4.5% 15/05/23 | 417,601 | 404,772 | 0.05 |
| USD | 200,000 | DKT FINANCE 9.3750% 17/06/23 144A | 200,000 | 202,250 | 0.02 |
| | | | 1,114,745 | 1,112,979 | 0.13 |
| | | 合計：デンマーク | 1,789,973 | 1,871,589 | 0.22 |
| ドミニカ共和国 | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 570,000 | DOMINICAN REP 6.5000% 15/02/48 REGS | 569,999 | 537,982 | 0.05 |
| USD | 300,000 | DOMINICAN REP 6.875% 29/01/26 REGS | 325,802 | 315,810 | 0.04 |
| USD | 250,000 | DOMINICAN REP 6.85% 27/01/45 REGS | 250,879 | 246,023 | 0.03 |
| USD | 150,000 | DOMINICAN REP 5.5% 27/01/25 REGS | 148,839 | 148,835 | 0.02 |
| USD | 140,000 | DOMINICAN REP 6.6% 28/01/24 REGS | 151,107 | 147,120 | 0.02 |
| USD | 130,000 | DOMINICAN REP 7.45% 30/04/44 REGS | 135,022 | 137,350 | 0.02 |
| | | | 1,581,648 | 1,533,120 | 0.18 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 191,000 | DOMINICAN REP 5.875% 18/04/24 REGS | 194,260 | 195,508 | 0.02 |
| USD | 130,000 | DOMINICAN REP 7.5% 06/05/21 | 146,550 | 136,110 | 0.02 |
| | | | 340,810 | 331,618 | 0.04 |
| | | 合計：ドミニカ共和国 | 1,922,458 | 1,864,738 | 0.22 |
| エクアドル | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 4,114,000 | REPUBLIC OF E 7.8750% 23/01/28 REGS | 4,020,395 | 3,455,759 | 0.41 |
| USD | 830,000 | REP OF ECUADOR 9.65% 13/12/26 REGS | 834,487 | 777,461 | 0.09 |
| USD | 775,000 | REPUBLIC OF E 8.8750% 23/10/27 REGS | 772,675 | 689,363 | 0.08 |
| USD | 590,000 | REP OF ECUADOR 10.75% 28/03/22 REGS | 630,799 | 605,163 | 0.07 |
| USD | 551,000 | REPUBLIC OF ECUA 9.6250% 02/06/27 | 544,000 | 511,973 | 0.06 |
| USD | 410,000 | REP OF ECUADOR 7.95% 20/06/24 REGS | 405,471 | 361,907 | 0.04 |
| USD | 376,000 | REPUBLIC OF ECUA 8.7500% 02/06/23 | 373,745 | 351,560 | 0.04 |
| | | | 7,581,572 | 6,753,186 | 0.79 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 3,200,000 | PETROAMAZONAS 4.6250% 06/11/20 REGS | 2,916,000 | 2,900,000 | 0.33 |
| USD | 530,000 | EP PETROECUADOR FRN 24/09/19 REGS | 136,823 | 137,033 | 0.02 |
| | | | 3,052,823 | 3,037,033 | 0.35 |
| | | 合計：エクアドル | 10,634,395 | 9,790,219 | 1.14 |
| エジプト | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 1,451,000 | ARAB REP EGYPT 6.5880% 21/02/28 REGS | 1,453,500 | 1,334,920 | 0.16 |
| USD | 880,000 | ARAB REPUBLIC EGYPT 8.5% 31/1/47 RE | 981,513 | 858,000 | 0.10 |
| USD | 200,000 | ARAB REP EGYPT 5.5770% 21/02/23 REGS | 200,000 | 190,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ARAB REP EGYPT 7.9030% 21/02/48 REGS | 200,000 | 182,500 | 0.02 |
| USD | 80,000 | ARAB REP EGYPT 7.5% 31/01/27 REGS | 85,425 | 78,900 | 0.01 |
| | | | 2,920,438 | 2,644,320 | 0.31 |
| | | 合計：エジプト | 2,920,438 | 2,644,320 | 0.31 |

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(%) |
|---------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------------|------------------|-------------|
| エルサルバドル | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 639,000 | REP EL SALVADOR 8.625% 28/2/29 REG | 714,591 | 683,052 | 0.09 |
| USD | 300,000 | REP EL SALVADOR 7.625% 1/2/41 REGS | 280,700 | 289,874 | 0.03 |
| USD | 183,000 | REP EL SALVADOR 6.375% 18/01/27 REG | 178,065 | 171,563 | 0.02 |
| USD | 60,000 | REP EL SALVADOR 5.875% 30/01/25 REG | 60,018 | 56,025 | 0.01 |
| USD | 40,000 | REP EL SALVADOR 8.25% 10/04/32 REGS | 49,176 | 41,085 | 0.00 |
| USD | 42,000 | REP EL SALVADOR 7.65% 15/6/35 REGS | 46,045 | 40,898 | 0.00 |
| | | | <u>1,328,595</u> | <u>1,282,497</u> | <u>0.15</u> |
| | | 合計：エルサルバドル | <u>1,328,595</u> | <u>1,282,497</u> | <u>0.15</u> |
| エチオピア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 200,000 | REP OF ETHIOPIA 6.625% 11/12/24 R | 180,500 | 195,000 | 0.02 |
| | | | <u>180,500</u> | <u>195,000</u> | <u>0.02</u> |
| | | 合計：エチオピア | <u>180,500</u> | <u>195,000</u> | <u>0.02</u> |
| フィンランド | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 840,000 | OUTOKUMPU OYJ 4.1250% 18/06/24 | 990,445 | 976,586 | 0.11 |
| USD | 100,000 | NOKIA OYJ 3.3750% 12/06/22 | 99,499 | 97,116 | 0.01 |
| | | | <u>1,089,944</u> | <u>1,073,702</u> | <u>0.12</u> |
| | | 合計：フィンランド | <u>1,089,944</u> | <u>1,073,702</u> | <u>0.12</u> |
| フランス | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 1,500,000 | SOCIETE GENERALE FRN 19/12/49 | 2,170,091 | 1,916,663 | 0.22 |
| EUR | 1,200,000 | SOLVAY FINANCE FRN 29/06/49 | 1,345,155 | 1,565,618 | 0.18 |
| EUR | 600,000 | ELEC DE FRANCE FRN 29/12/49 | 840,171 | 748,777 | 0.09 |
| USD | 800,000 | SCOR SE FRN 13/09/66 | 800,000 | 712,000 | 0.08 |
| EUR | 600,000 | LA POSTE SA FRN 29/01/67 | 730,179 | 662,452 | 0.08 |
| USD | 560,000 | CREDIT AGRICOLE FRN 29/01/49 REGS | 560,000 | 572,992 | 0.07 |
| | | | <u>6,445,596</u> | <u>6,178,502</u> | <u>0.72</u> |
| その他債券 | | | | | |
| EUR | 472,000 | NOVASEP HLDG 8% PIK 31/05/19 | 481,237 | 530,781 | 0.06 |
| | | | <u>481,237</u> | <u>530,781</u> | <u>0.06</u> |
| ステップアップ/ダウン債 | | | | | |
| EUR | 400,000 | CASINO GUICHARD STUP 26/05/21 EMT | 513,423 | 498,388 | 0.06 |
| | | | <u>513,423</u> | <u>498,388</u> | <u>0.06</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 2,100,000 | AREVA 4.875% 23/09/24 EMTN | 2,673,561 | 2,560,362 | 0.29 |
| EUR | 1,850,000 | PAPREC HOLDIN 4.0000% 31/03/25 REGS | 2,290,575 | 2,126,065 | 0.24 |
| USD | 1,575,000 | NUMERICABLE GRP 6% 15/05/22 144A | 1,566,857 | 1,590,482 | 0.18 |
| EUR | 1,320,000 | NOVALIS SAS 3% 30/04/22 RegS | 1,436,234 | 1,555,946 | 0.18 |
| EUR | 1,270,000 | SYNLAB BONDCO 6.25% 01/07/22 REGS | 1,437,923 | 1,516,714 | 0.18 |
| EUR | 1,200,000 | SFR GROUP SA 5.625% 15/05/24 REGS | 1,546,615 | 1,449,546 | 0.17 |
| EUR | 1,300,000 | LOUVRE BIDCO 4.2500% 30/09/24 REGS | 1,567,248 | 1,425,241 | 0.17 |
| EUR | 1,100,000 | WFS GLOBAL HDGS 9.5% 15/07/22 REGS | 1,134,671 | 1,340,288 | 0.16 |
| EUR | 1,000,000 | VERALLIA PACK 5.125% 01/08/22 REG | 1,137,313 | 1,192,985 | 0.14 |
| EUR | 1,000,000 | CMA CGM SA 6.5000% 15/07/22 REGS | 1,141,850 | 1,078,103 | 0.13 |
| EUR | 1,100,000 | CMA CGM SA 5.2500% 15/01/25 REGS | 1,179,177 | 1,036,146 | 0.12 |
| EUR | 900,000 | CASINO GUICHA 1.8650% 13/06/22 EMTN | 1,080,556 | 980,264 | 0.11 |
| EUR | 800,000 | CROWN EURO HOLD 3.375% 15/5/25 REGS | 854,392 | 940,375 | 0.11 |
| EUR | 700,000 | PEUGEOT 2.0000% 20/03/25 EMTN | 859,440 | 791,866 | 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 | 700,000 | TEREOS FIN GP 4.125% 16/06/23 | 786,290 | 765,648 | 0.09 |
| EUR | 610,000 | FAURECIA 2.6250% 15/06/25 | 748,714 | 716,036 | 0.08 |
| EUR | 520,000 | LOXAM SAS 6% 15/04/25 REGS | 562,406 | 637,513 | 0.07 |
| EUR | 550,000 | LA FINAC ATALIAN 4% 15/05/24 REGS | 601,865 | 604,425 | 0.07 |
| EUR | 500,000 | SPCM SA 2.875% 15/06/23 REGS | 571,159 | 583,877 | 0.07 |
| EUR | 500,000 | AREVA SA 3.125% 20/03/23 EMTN | 482,602 | 578,244 | 0.07 |
| EUR | 500,000 | NEXANS SA 2.75% 05/04/24 | 540,775 | 567,993 | 0.07 |
| EUR | 500,000 | MOBILUX FIN SAS 5.5% 15/11/24 REGS | 546,301 | 559,171 | 0.07 |
| EUR | 500,000 | CASINO GUICHARD 2.33% 07/02/25 EMTN | 567,509 | 545,180 | 0.06 |
| EUR | 400,000 | NOVAFIVES 5.0000% 15/06/25 REGS | 494,440 | 443,232 | 0.05 |
| EUR | 350,000 | VALLOUREC SA 6.3750% 15/10/23 REGS | 432,635 | 399,076 | 0.05 |
| EUR | 360,000 | THREEAB OPTIQ 4.0000% 01/10/23 REGS | 420,840 | 394,018 | 0.05 |
| EUR | 270,000 | LA FIN ATALIA 5.1250% 15/05/25 REGS | 328,820 | 299,382 | 0.03 |
| USD | 265,000 | NUMERICABLE GRP 6.25% 15/05/24 144A | 250,425 | 256,719 | 0.03 |
| EUR | 210,000 | CONSTANTIN IN 5.3750% 15/04/25 REGS | 236,139 | 227,920 | 0.03 |
| USD | 200,000 | SPCM SA 4.875% 15/09/25 144A | 200,000 | 191,000 | 0.02 |
| EUR | 130,000 | LOXAM SAS 4.25% 15/04/24 REGS | 140,601 | 157,015 | 0.02 |
| | | | <u>27,817,933</u> | <u>27,510,832</u> | <u>3.20</u> |
| | | 合計：フランス | <u>35,258,189</u> | <u>34,718,503</u> | <u>4.04</u> |
| | | ガボン | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 240,000 | GABONESE REP 6.95% 16/06/25 REGS | 240,000 | 217,200 | 0.03 |
| | | | <u>240,000</u> | <u>217,200</u> | <u>0.03</u> |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 341,000 | GABONESE REP 6.375% 12/12/24 REGS | 342,728 | 307,753 | 0.03 |
| | | | <u>342,728</u> | <u>307,753</u> | <u>0.03</u> |
| | | 合計：ガボン | <u>582,728</u> | <u>524,953</u> | <u>0.06</u> |
| | | ジョージア | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 150,000 | REP OF GEORGIA 6.875% 12/04/21 REGS | 174,000 | 159,188 | 0.02 |
| | | | <u>174,000</u> | <u>159,188</u> | <u>0.02</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 150,000 | JSC GEORGIAN RAIL 7.75% 11/07/22 RE | 163,848 | 157,440 | 0.02 |
| | | | <u>163,848</u> | <u>157,440</u> | <u>0.02</u> |
| | | 合計：ジョージア | <u>337,848</u> | <u>316,628</u> | <u>0.04</u> |
| | | ドイツ | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 800,000 | PROGROUP AG FRN 31/03/24 REGS | 856,480 | 920,616 | 0.10 |
| EUR | 500,000 | HT1 FUNDING/COMMERZBK FRN 29/07/49 * | 409,450 | 558,991 | 0.07 |
| EUR | 400,000 | AAREAL BK AG FRN 29/11/49 | 434,486 | 485,055 | 0.06 |
| EUR | 330,000 | LANXESS AG FRN 06/12/76 | 345,063 | 412,080 | 0.05 |
| | | | <u>2,045,479</u> | <u>2,376,742</u> | <u>0.28</u> |
| 国債 | | | | | |
| EUR | 1,350,000 | DEUTSCHLAND REP 2.0000% 15/08/23 | 1,764,565 | 1,753,221 | 0.20 |
| EUR | 200,000 | BUNDESUBL-120 0.0000% 14/04/23 177 | 235,454 | 235,807 | 0.03 |
| | | | <u>2,000,019</u> | <u>1,989,028</u> | <u>0.23</u> |
| その他債券 | | | | | |
| EUR | 1,500,000 | UNITYMEDIA 6.2500% 15/01/29 REGS | 1,677,420 | 1,755,640 | 0.20 |
| | | | <u>1,677,420</u> | <u>1,755,640</u> | <u>0.20</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(%) |
|-------------------------|----------------------------|-------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------|
| ベイ・イン・カインド(PIK)債 | | | | | |
| EUR | 1,070,000 | IHO VERWALTUNG PIK 3.25% 15/9/23 RE | 1,204,285 | 1,256,097 | 0.15 |
| EUR | 710,000 | IHO VERWALTUNG PIK 3.75% 15/9/26 RE | 828,569 | 839,180 | 0.10 |
| EUR | 670,000 | IHO VERWALT PIK 2.75% 15/09/21 REGS | 754,085 | 785,859 | 0.09 |
| USD | 200,000 | SCHAEFFLER VE PIK 4.125% 15/9/21 14 | 200,000 | 196,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | SCHAEFFLER VER PIK 4.5% 15/09/23 14 | 200,000 | 190,000 | 0.02 |
| | | | <u>3,186,939</u> | <u>3,267,136</u> | <u>0.38</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 1,600,000 | WITTUR INTL HLDG 8.5% 15/2/23 REGS | 1,852,206 | 1,874,576 | 0.22 |
| EUR | 1,460,000 | UNITYMEDIA HESSEN 4% 15/01/25 REGS | 1,711,525 | 1,775,103 | 0.21 |
| EUR | 1,415,000 | PROGROUP 3.0000% 31/03/26 REGS | 1,744,482 | 1,597,371 | 0.19 |
| EUR | 1,100,000 | NIDDA HEALTHC 3.5000% 30/09/24 REGS | 1,291,918 | 1,204,278 | 0.14 |
| EUR | 1,010,000 | SAFARI HOLDIN 5.3750% 30/11/22 REGS | 1,203,718 | 1,155,140 | 0.13 |
| EUR | 1,030,000 | RAFFINERIE HE 6.3750% 01/12/22 REGS | 1,221,013 | 1,151,533 | 0.13 |
| EUR | 1,000,000 | KME AG 6.7500% 01/02/23 REGS | 1,236,467 | 1,150,910 | 0.13 |
| EUR | 750,000 | TELE COLUMBUS 3.8750% 02/05/25 REGS | 901,411 | 827,808 | 0.10 |
| EUR | 720,000 | PLATIN 1426 G 5.3750% 15/06/23 REGS | 849,456 | 799,323 | 0.09 |
| EUR | 600,000 | ADLER REAL EST 3.0000% 27/04/26 | 729,227 | 679,856 | 0.08 |
| EUR | 500,000 | ADLER REAL EST 2.1250% 06/02/24 | 588,351 | 564,260 | 0.07 |
| EUR | 400,000 | CTC BONDCO GM 5.2500% 15/12/25 REGS | 474,580 | 442,743 | 0.05 |
| EUR | 425,000 | CBR FASHION F 5.1250% 01/10/22 REGS | 480,590 | 421,819 | 0.05 |
| USD | 400,000 | UNITYMEDIA KABEL 6.125% 15/01/25 14 | 400,000 | 413,000 | 0.05 |
| EUR | 300,000 | HP PELZER HLDG 4.125% 01/04/24 REGS | 322,920 | 350,433 | 0.04 |
| | | | <u>15,007,864</u> | <u>14,408,153</u> | <u>1.68</u> |
| | | 合計：ドイツ | <u>23,917,721</u> | <u>23,796,699</u> | <u>2.77</u> |
| ガーナ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 200,000 | GHANA REP OF 7.6250% 16/05/29 REGS | 200,500 | 195,250 | 0.03 |
| USD | 200,000 | GHANA REP OF 8.6270% 16/06/49 REGS | 199,250 | 195,000 | 0.02 |
| | | | <u>399,750</u> | <u>390,250</u> | <u>0.05</u> |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 350,000 | REP OF GHANA 8.125% 18/01/26 REGS | 365,883 | 359,233 | 0.04 |
| | | | <u>365,883</u> | <u>359,233</u> | <u>0.04</u> |
| | | 合計：ガーナ | <u>765,633</u> | <u>749,483</u> | <u>0.09</u> |
| ガーンジー | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 1,110,000 | GLOBALWORTH R 3.0000% 29/03/25 EMTN | 1,360,667 | 1,282,042 | 0.15 |
| EUR | 850,000 | SUMMIT GERMAN 2.0000% 31/01/25 144A | 1,040,401 | 943,138 | 0.11 |
| | | | <u>2,401,068</u> | <u>2,225,180</u> | <u>0.26</u> |
| | | 合計：ガーンジー | <u>2,401,068</u> | <u>2,225,180</u> | <u>0.26</u> |
| 香港 | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 800,000 | ICBC ASIA FRN 29/12/49 | 781,600 | 753,767 | 0.09 |
| USD | 300,000 | BANK OF EAST ASIA FRN 20/11/24 REGS | 299,040 | 299,652 | 0.03 |
| | | | <u>1,080,640</u> | <u>1,053,419</u> | <u>0.12</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 3,000,000 | CNAC HK FINBRID 4.8750% 14/03/25 | 2,980,350 | 2,980,833 | 0.35 |
| USD | 1,610,000 | CNAC HK FINBRID 5.1250% 14/03/28 | 1,599,310 | 1,588,557 | 0.18 |
| USD | 600,000 | CITIC PACIFIC 6.8% 17/01/23 REGS | 713,893 | 662,539 | 0.08 |
| USD | 100,000 | BANK EAST ASIA 6.1250% 16/07/20 | 106,400 | 104,440 | 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 | 70,000 | ICBC ASIA LTD 5.125% 30/11/20 | 76,199 | 72,096 | 0.01 |
| | | 合計：香港 | 5,476,152 | 5,408,465 | 0.63 |
| | | | 6,556,792 | 6,461,884 | 0.75 |
| ハンガリー | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 314,000 | HUNGARY GVT 5.375% 21/02/23 | 335,384 | 332,448 | 0.05 |
| USD | 236,000 | REP OF HUNGARY 5.75% 22/11/23 | 254,591 | 254,495 | 0.03 |
| USD | 180,000 | REP OF HUNGARY 5.375% 25/03/24 | 188,110 | 191,250 | 0.02 |
| USD | 28,000 | REP OF HUNGARY 7.625% 29/03/41 | 36,971 | 38,203 | 0.00 |
| | | | 815,056 | 816,396 | 0.10 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 1,110,000 | NITROGENMUEK 7.0000% 14/05/25 REGS | 1,331,113 | 1,256,428 | 0.14 |
| USD | 500,000 | MAGYAR EXPORT IMP 4% 30/01/20 REGS | 523,750 | 500,625 | 0.06 |
| | | 合計：ハンガリー | 1,854,863 | 1,757,053 | 0.20 |
| | | | 2,669,919 | 2,573,449 | 0.30 |
| インド | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 780,000 | PERTAMINA PT 6% 03/05/42 REGS | 767,698 | 777,074 | 0.09 |
| USD | 800,000 | RELIANCE INDU 3.6670% 30/11/27 REGS | 800,000 | 734,751 | 0.09 |
| USD | 700,000 | NTPC 5.625% 14/07/21 EMTN | 784,840 | 732,515 | 0.09 |
| USD | 600,000 | ADANI TRANS LTD 4% 03/08/26 REGS | 594,486 | 531,842 | 0.06 |
| USD | 500,000 | RELIANCE IND 4.125% 28/01/25 REGS | 523,500 | 486,764 | 0.06 |
| USD | 500,000 | BHARTI AIRTEL LTD 4.375% 10/6/25 RE | 502,650 | 463,895 | 0.05 |
| USD | 200,000 | EXPORT-IMP BK IN 3.375% 05/08/26 RE | 199,866 | 184,956 | 0.02 |
| USD | 90,000 | EXPORT IMPORT BK 4% 14/01/23 REGS | 90,506 | 89,180 | 0.01 |
| | | 合計：インド | 4,263,546 | 4,000,977 | 0.47 |
| | | | 4,263,546 | 4,000,977 | 0.47 |
| インドネシア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 2,500,000 | REP OF INDONESIA 4.75% 08/01/26 REG | 2,675,667 | 2,533,710 | 0.29 |
| USD | 1,157,000 | REP OF INDONES 5.25% 17/01/42 REGS | 1,219,846 | 1,164,231 | 0.14 |
| USD | 700,000 | REP OF INDONES 6.625% 17/02/37 REGS | 896,875 | 805,749 | 0.09 |
| USD | 495,000 | SBSN INDO III 4.4000% 01/03/28 REGS | 495,000 | 483,244 | 0.06 |
| USD | 290,000 | REP OF INDONESIA 5.125% 15/1/45 REG | 304,985 | 287,187 | 0.03 |
| USD | 249,000 | REP OF INDONESIA 5.25% 08/01/47 RE | 268,142 | 249,311 | 0.03 |
| USD | 166,000 | REP OF INDONESIA 7.75% 17/1/38 | 229,532 | 213,518 | 0.02 |
| | | 合計：インドネシア | 6,090,047 | 5,736,950 | 0.66 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,000,000 | PERUSAHAAN NEGA 5.125% 16/5/24 REG | 1,078,500 | 1,013,190 | 0.13 |
| USD | 855,000 | PERUSAHAAN LI 5.4500% 21/05/28 REGS | 851,742 | 869,037 | 0.10 |
| USD | 750,000 | PERUSAHAAN LI 6.1500% 21/05/48 REGS | 744,923 | 756,431 | 0.09 |
| USD | 400,000 | PERTAMINA 6.5% 27/05/41 | 393,520 | 420,922 | 0.05 |
| USD | 260,000 | PERUSAHAAN LISTRIK 5.5% 22/11/21 | 277,420 | 271,378 | 0.03 |
| USD | 200,000 | PERUSAHAAN PEN 4.55% 29/03/26 REGS | 200,000 | 199,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | PERUSAHAAN PEN 4.325% 28/05/25 REGS | 200,000 | 198,570 | 0.02 |
| USD | 200,000 | INDONESIA REP 4.7500% 18/07/47 REGS | 198,418 | 188,865 | 0.02 |
| USD | 200,000 | PERUSAHAAN LISTRIK 5.25% 15/05/47 R | 197,028 | 181,536 | 0.02 |
| | | 合計：インドネシア | 4,141,551 | 4,098,929 | 0.48 |
| | | | 10,231,598 | 9,835,879 | 1.14 |

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|---------------|----------------------------|-------------------------------------|------------|------------|---------|
| イラク | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 975,000 | REPUBLIC OF IRAQ 6.7520% 09/03/23 | 975,000 | 934,781 | 0.11 |
| | | | 975,000 | 934,781 | 0.11 |
| | | 合計：イラク | 975,000 | 934,781 | 0.11 |
| 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 | 1,228,248 | 0.15 |
| EUR | 560,000 | ALLIED IRISH BK FRN 26/11/25 EMTN | 598,737 | 681,968 | 0.08 |
| USD | 210,000 | BANK OF IRELAND FRN 19/09/27 EMTN | 208,904 | 197,702 | 0.02 |
| | | | 2,204,236 | 2,107,918 | 0.25 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 1,300,000 | GOVERNOR & CO 10% 19/12/22 EMTN | 1,853,314 | 2,041,296 | 0.23 |
| EUR | 1,075,000 | ARDAGH PKG FIN 6.75% 15/05/24 REGS | 1,258,885 | 1,343,905 | 0.15 |
| GBP | 1,010,000 | VIRGIN MEDIA REC 5.5% 15/09/24 REGS | 1,371,556 | 1,302,664 | 0.14 |
| EUR | 750,000 | SMURFIT KAPPA 3.25% 01/06/21 REGS | 939,705 | 928,255 | 0.11 |
| USD | 865,000 | ARDAGH PKG FIN 6% 15/02/25 144A | 872,725 | 843,375 | 0.10 |
| USD | 800,000 | VEB FINANCE 6.902% 09/07/20 | 836,800 | 830,000 | 0.10 |
| EUR | 610,000 | ARDAGH PKG FIN 4.125% 15/05/23 REGS | 691,545 | 736,654 | 0.09 |
| USD | 725,000 | METALLOINVEST FIN 4.85% 02/05/24 RE | 725,000 | 689,910 | 0.08 |
| USD | 680,000 | MMC NORILSK NICK O 4.1% 11/04/23 RE | 680,000 | 647,700 | 0.08 |
| EUR | 540,000 | EIRCOM FINANCE 4.5% 31/05/22 REGS | 613,278 | 638,859 | 0.07 |
| USD | 500,000 | ROSNEFT 4.199% 06/03/22 REGS | 499,375 | 487,650 | 0.06 |
| USD | 410,000 | VEB FINANCE PLC 5.942% 21/11/23 REG | 391,530 | 422,628 | 0.05 |
| USD | 400,000 | ARDAGH PKG FIN 7.25% 15/05/24 144A | 416,812 | 416,000 | 0.05 |
| USD | 361,000 | VEB FINANCE PLC 6.025% 05/07/22 REG | 326,833 | 370,928 | 0.04 |
| USD | 234,000 | SCF CAPITAL 5.375% 16/06/23 REGS | 234,000 | 233,555 | 0.03 |
| EUR | 200,000 | ROADSTER FIN 2.3750% 08/12/27 EMTN | 237,585 | 225,236 | 0.03 |
| USD | 200,000 | ARDAGH PKG FIN 4.25% 15/09/22 144A | 200,000 | 196,250 | 0.02 |
| USD | 200,000 | JAMES HARDIE 5.0000% 15/01/28 144A | 200,000 | 189,000 | 0.02 |
| | | | 12,348,943 | 12,543,865 | 1.45 |
| | | 合計：アイルランド | 14,553,179 | 14,651,783 | 1.70 |
| イスラエル | | | | | |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 480,000 | DELEK&AVNER YAM 5.412% 30/12/25 14 | 490,896 | 481,440 | 0.06 |
| | | | 490,896 | 481,440 | 0.06 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 500,000 | ISRAEL ELECTRIC 5% 12/11/24 | 522,950 | 514,845 | 0.05 |
| USD | 70,000 | ISRAEL CHEMICALS 6.3750% 31/05/38 | 69,674 | 69,089 | 0.01 |
| | | | 592,624 | 583,934 | 0.06 |
| | | 合計：イスラエル | 1,083,520 | 1,065,374 | 0.12 |
| イタリア | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 1,100,000 | ASSICURAZIONI GEN FRN 27/10/47 EMTN | 1,452,421 | 1,352,110 | 0.15 |
| USD | 1,430,000 | UNICREDIT SPA FRN 31/12/50 | 1,430,000 | 1,340,270 | 0.16 |
| EUR | 1,040,000 | INTESA SANPAOLO FRN 29/07/49 | 1,093,553 | 1,302,473 | 0.15 |
| EUR | 800,000 | UNICREDIT SPA FRN 10/03/67 | 1,051,195 | 936,814 | 0.11 |
| EUR | 500,000 | INTESA SANPAOLO FRN 29/10/49 PERP | 644,552 | 616,984 | 0.07 |
| EUR | 200,000 | UNICREDIT SPA FRN 03/12/66 | 280,805 | 230,430 | 0.03 |
| | | | 5,952,526 | 5,779,081 | 0.67 |

| 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 | | | | | |
| EUR | 840,000 | INTER MEDIA C 4.8750% 31/12/22 REGS | 993,678 | 975,414 | 0.11 |
| | | | 993,678 | 975,414 | 0.11 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 2,280,000 | WIND TRE SPA 3.1250% 20/01/25 REGS | 2,682,307 | 2,147,226 | 0.26 |
| EUR | 900,000 | INTESA SANPAO 6.6250% 13/09/23 EMTN | 1,233,971 | 1,221,225 | 0.14 |
| EUR | 1,360,000 | ONORATO ARMATORI 7.75% 15/02/23 REG | 1,445,597 | 1,201,309 | 0.14 |
| GBP | 500,000 | TELECOM ITALIA 5.875% 19/05/23 EMT | 859,753 | 721,526 | 0.08 |
| GBP | 500,000 | TELECOM ITALIA 6.375% 24/06/19 EMTN | 847,059 | 683,542 | 0.08 |
| EUR | 430,000 | TELECOM ITALIA SPA 3% 30/09/25 EMTN | 480,537 | 507,608 | 0.06 |
| EUR | 460,000 | PRO-GEST SPA 3.2500% 15/12/24 REGS | 542,708 | 506,589 | 0.06 |
| EUR | 440,000 | ALMAVIVA 7.2500% 15/10/22 REGS | 516,274 | 502,480 | 0.06 |
| EUR | 500,000 | CMF SPA 9.0000% 15/06/22 REGS | 558,869 | 494,741 | 0.06 |
| EUR | 400,000 | TELECOM ITALIA SPA 3.625% 25/5/26 E | 451,560 | 489,217 | 0.06 |
| EUR | 330,000 | TELECOM ITALI 2.8750% 28/01/26 EMTN | 381,529 | 381,522 | 0.04 |
| EUR | 270,000 | TELECOM ITALIA SPA 2.5% 19/07/23 EM | 284,068 | 320,637 | 0.04 |
| EUR | 150,000 | TELECOM ITALI 2.3750% 12/10/27 EMTN | 174,895 | 164,188 | 0.02 |
| USD | 200,000 | WIND TRE SPA 5.0000% 20/01/26 | 179,000 | 158,500 | 0.02 |
| EUR | 130,000 | PIAGGIO & C 3.6250% 30/04/25 REGS | 160,940 | 150,857 | 0.02 |
| EUR | 100,000 | TELECOM ITALI 5.2500% 17/03/55 EMTN | 141,652 | 119,813 | 0.01 |
| EUR | 100,000 | UNIPOL GRUPPO 3.5000% 29/11/27 EMTN | 120,249 | 111,444 | 0.01 |
| | | | 11,060,968 | 9,882,424 | 1.16 |
| | | 合計：イタリア | 18,007,172 | 16,636,919 | 1.94 |
| コートジボワール | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 420,000 | IVORY COAST-P 6.1250% 15/06/33 REGS | 414,737 | 370,125 | 0.04 |
| | | | 414,737 | 370,125 | 0.04 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 634,000 | IVORY COAST FRN 31/12/32 REGS | 573,520 | 556,442 | 0.07 |
| | | | 573,520 | 556,442 | 0.07 |
| | | 合計：コートジボワール | 988,257 | 926,567 | 0.11 |
| ジャマイカ | | | | | |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 400,000 | JAMAICA GVT 6.75% 28/04/28 | 426,496 | 427,500 | 0.05 |
| | | | 426,496 | 427,500 | 0.05 |
| | | 合計：ジャマイカ | 426,496 | 427,500 | 0.05 |
| 日本 | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 1,640,000 | SOFTBANK GRP COR 5.0000% 15/04/28 | 1,629,491 | 1,853,752 | 0.22 |
| EUR | 700,000 | SOFTBANK GRP COR 4.0000% 19/09/29 | 836,850 | 721,355 | 0.08 |
| EUR | 400,000 | SOFTBANK GRP COR 4.0000% 20/04/23 | 482,916 | 479,240 | 0.06 |
| | | | 2,949,257 | 3,054,347 | 0.36 |
| | | 合計：日本 | 2,949,257 | 3,054,347 | 0.36 |
| ジャージー | | | | | |
| 転換社債 | | | | | |
| USD | 375,000 | ENSCO JERS CV 3.0000% 31/01/24 144A | 318,563 | 349,199 | 0.04 |
| | | | 318,563 | 349,199 | 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(%) |
|-------------------------|----------------------------|--------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 800,000 | MERCURY BONDCO FRN 30/05/21 REGs | 809,846 | 930,444 | 0.11 |
| | | | 809,846 | 930,444 | 0.11 |
| ペイ・イン・カインド(PIK)債 | | | | | |
| EUR | 1,000,000 | MERCURY BONDCO PIK 9% 30/05/21 REGS | 1,110,287 | 1,210,199 | 0.14 |
| EUR | 326,960 | MERCURY BOND PIK 7.125% 30/5/21 REG | 403,740 | 393,494 | 0.05 |
| EUR | 300,000 | LHC THREE PLC PIK 15/08/24 REGS | 352,800 | 347,382 | 0.04 |
| | | | 1,866,827 | 1,951,075 | 0.23 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 2,500,000 | MAIN CAPITAL FDG 5.5% 29/06/49 | 2,183,698 | 3,008,933 | 0.35 |
| EUR | 1,000,000 | LINCOLN FIN 6.875% 15/04/21 REGS | 1,164,549 | 1,200,075 | 0.14 |
| EUR | 500,000 | KENNEDY WILSO 3.2500% 12/11/25 EMTN | 600,142 | 589,353 | 0.07 |
| EUR | 500,000 | ADIENT GLB HDGS 3.5% 15/08/24 REGS | 543,912 | 538,209 | 0.06 |
| GBP | 400,000 | HEATHROW FIN LTD 3.875% 01/03/27 | 519,020 | 499,695 | 0.06 |
| USD | 350,000 | BK INDIA/JERSEY 3.125% 6/05/20 REGS | 349,125 | 342,830 | 0.04 |
| USD | 275,000 | DELPHI JERSEY 5.0000% 01/10/25 144A | 274,750 | 262,453 | 0.03 |
| USD | 200,000 | ASTON MARTIN CAP 6.5% 15/04/22 144A | 200,000 | 204,100 | 0.02 |
| | | | 5,835,196 | 6,645,648 | 0.77 |
| | | 合計：ジャージー | 8,830,432 | 9,876,366 | 1.15 |
| ヨルダン | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 200,000 | KINGDOM OF JORDAN 5.75% 31/01/27 RE | 199,256 | 185,480 | 0.02 |
| | | | 199,256 | 185,480 | 0.02 |
| | | 合計：ヨルダン | 199,256 | 185,480 | 0.02 |
| カザフスタン | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 160,000 | REP KAZAKHSTAN 6.5% 21/07/45 REGS | 158,478 | 188,320 | 0.02 |
| | | | 158,478 | 188,320 | 0.02 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 901,000 | KAZMUNAYGAS N 5.3750% 24/04/30 REGS | 901,001 | 903,537 | 0.10 |
| USD | 667,000 | BTA BANK 5.5% 21/12/22 REGS | 567,083 | 665,066 | 0.08 |
| USD | 660,000 | KAZTRANS GAS J 4.3750% 26/09/27 REGS | 658,673 | 612,150 | 0.07 |
| USD | 500,000 | KAZMUNAYGAS N 6.3750% 24/10/48 REGS | 495,025 | 504,627 | 0.06 |
| USD | 500,000 | KAZMUNAYGAS NTL 4.75% 19/04/27 REGS | 495,100 | 487,500 | 0.06 |
| USD | 220,000 | DEVEL BK KAZA 4.125% 10/12/22 REGS | 203,796 | 215,336 | 0.03 |
| USD | 200,000 | KAZAGRO NTL MGMT 4.625% 24/05/23 RE | 169,500 | 192,300 | 0.02 |
| USD | 192,000 | KAZMUNAIGAZ FIN 9.125% 02/7/18 | 218,093 | 192,000 | 0.02 |
| | | | 3,708,271 | 3,772,516 | 0.44 |
| | | 合計：カザフスタン | 3,866,749 | 3,960,836 | 0.46 |
| ケニア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 500,000 | KENYA REP OF 7.2500% 28/02/28 REGS | 500,000 | 480,000 | 0.06 |
| USD | 190,000 | REP OF KENYA 6.875% 24/06/24 REGS | 190,000 | 188,011 | 0.02 |
| USD | 200,000 | KENYA REP OF 8.2500% 28/02/48 REGS | 199,500 | 187,500 | 0.02 |
| | | | 889,500 | 855,511 | 0.10 |
| | | 合計：ケニア | 889,500 | 855,511 | 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(%) |
|-------------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| レバノン | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 2,521,000 | REP OF LEBANON 6.1% 04/10/22 EMTN | 2,564,620 | 2,174,362 | 0.25 |
| USD | 875,000 | LEBANESE REP 6.65% 22/04/24 | 897,580 | 736,093 | 0.09 |
| USD | 390,000 | REP OF LEBANON 8.25% 12/04/21 REGS | 415,748 | 372,937 | 0.04 |
| USD | 190,000 | LEBANESE REPUBLIC 5.45% 28/11/19 GM | 188,450 | 182,163 | 0.02 |
| USD | 145,000 | REP OF LEBANON 5.15% 12/11/18 EMTN | 145,631 | 144,609 | 0.02 |
| USD | 120,000 | REP OF LEBANON 6.375% 9/03/20 GMTN | 124,749 | 114,900 | 0.01 |
| USD | 89,000 | REP OF LEBANON 6.75% 29/11/27 REGS | 89,218 | 68,975 | 0.01 |
| USD | 14,000 | REP OF LEBANON 6.6% 27/11/26 GMTN | 14,326 | 10,938 | 0.00 |
| | | | 4,440,322 | 3,804,977 | 0.44 |
| | | 合計：レバノン | 4,440,322 | 3,804,977 | 0.44 |
| ルクセンブルグ | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 600,000 | EUROFINS SCIENTIFIC FRN 31/12/49 | 643,681 | 733,447 | 0.09 |
| EUR | 450,000 | EUROFINS SCIEN FRN 13/11/66 | 524,759 | 492,086 | 0.06 |
| EUR | 400,000 | GALAPAGOS SA FRN 15/06/21 REGS | 399,769 | 413,779 | 0.05 |
| EUR | 110,000 | LHMC FINCO SARL FRN 20/12/23 REGS | 124,786 | 125,114 | 0.01 |
| | | | 1,692,995 | 1,764,426 | 0.21 |
| その他債券 | | | | | |
| EUR | 2,000,000 | TELENET FIN VI 4.875% 15/7/27 REGS | 1,926,952 | 2,210,497 | 0.25 |
| EUR | 1,100,000 | LSF9 BALTA ISSUE 7.75% 15/09/22 REG | 1,044,739 | 1,080,617 | 0.13 |
| EUR | 570,000 | EDREAMS ODIGE 8.5000% 01/08/21 REGS | 610,400 | 671,392 | 0.08 |
| EUR | 1,000,000 | DAKAR FINANCE PIK 9% 15/11/20 REGS | 297,007 | 310,030 | 0.04 |
| | | | 3,879,098 | 4,272,536 | 0.50 |
| ベイ・イン・カインド(PIK)債 | | | | | |
| EUR | 2,000,000 | PRAGUE CE SARL PIK 15/12/22 REGS | 2,304,310 | 2,287,314 | 0.26 |
| USD | 600,000 | ARD FIN SA PIK 7.125% 15/09/23 WI | 605,450 | 601,500 | 0.07 |
| USD | 400,000 | ARD SECURITIES PIK 31/01/23 144A | 419,000 | 407,000 | 0.05 |
| EUR | 100,000 | KLEOPATRA HLDS PIK 30/06/23 REGS | 113,380 | 87,147 | 0.01 |
| | | | 3,442,140 | 3,382,961 | 0.39 |
| ステップアップ/ダウン債 | | | | | |
| USD | 100,000 | ARCELORMITTAL 6.75% 01/03/41 | 130,375 | 112,750 | 0.01 |
| USD | 85,000 | ARCELORMITTAL STUP 15/10/39 | 99,910 | 97,750 | 0.01 |
| | | | 230,285 | 210,500 | 0.02 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 2,452,000 | ALTICE SA 7.25% 15/05/22 REGS | 2,955,781 | 2,870,422 | 0.32 |
| EUR | 1,500,000 | TELECOM ITALIA FIN 7.75% 24/1/33 EM | 2,521,814 | 2,396,106 | 0.27 |
| EUR | 1,500,000 | MATTERHORN TEL 3.875% 01/05/22 REGS | 1,616,173 | 1,762,038 | 0.20 |
| EUR | 1,350,000 | FIAT FIN&TRADE 6.75% 14/10/19 GMTN | 1,736,370 | 1,687,761 | 0.19 |
| EUR | 1,336,000 | DEA FINANCE SA 7.5% 15/10/22 REGS | 1,610,660 | 1,668,519 | 0.18 |
| USD | 1,500,000 | ALTICE FIN SA 7.5% 15/05/26 REGS | 1,592,896 | 1,450,800 | 0.16 |
| USD | 1,360,000 | SBERBANK 6.125% 07/02/22 REGS | 1,490,696 | 1,419,432 | 0.17 |
| EUR | 1,000,000 | EUROFINS SCIENTIFIC 3.375% 30/01/23 | 1,114,490 | 1,234,894 | 0.14 |
| EUR | 1,040,000 | CONTOURGLOBAL 5.125% 15/06/21 REGS | 1,174,311 | 1,231,595 | 0.14 |
| USD | 1,200,000 | GAZPROM 4.95% 19/07/22 REGS | 1,206,996 | 1,210,500 | 0.14 |
| EUR | 1,130,000 | TAKKO LUX 2 S 5.3750% 15/11/23 REGS | 1,328,135 | 1,185,343 | 0.14 |
| EUR | 1,000,000 | GESTAMP FUND LUX 3.5% 15/05/23 REGS | 1,185,088 | 1,181,769 | 0.14 |
| USD | 1,280,000 | PUMA INTERNAT 5.1250% 06/10/24 REGS | 1,257,483 | 1,143,667 | 0.13 |
| USD | 1,145,000 | VH HOLDING SA 5.375% 04/05/27 REGS | 1,159,839 | 1,116,375 | 0.13 |
| USD | 1,200,000 | JSL EUROPE 7.7500% 26/07/24 REGS | 1,232,860 | 1,087,104 | 0.13 |

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 | ALTICE FINANCING 5.25% 15/02/23 REG | 1,021,174 | 1,081,396 | 0.13 |
| EUR | 1,030,000 | ALTICE FINCO 4.7500% 15/01/28 REGS | 1,174,661 | 1,018,810 | 0.12 |
| EUR | 900,000 | GARFUNKELUX HOLDCO 7.5% 1/8/22 REGS | 998,293 | 1,017,081 | 0.12 |
| EUR | 900,000 | CODERE FIN 2 LUX 6.75% 1/11/21 REGs | 970,119 | 995,859 | 0.12 |
| USD | 1,000,000 | ALTICE SA 7.75% 15/05/22 144A | 958,041 | 971,350 | 0.11 |
| EUR | 800,000 | LECTA SA 6.5% 01/08/23 REGs | 883,823 | 915,892 | 0.11 |
| EUR | 700,000 | CRYSTAL ALMOND SARL 10% 01/11/21 RE | 748,014 | 861,611 | 0.10 |
| USD | 770,000 | MILLICOM INTL 6% 15/03/25 REGS | 785,700 | 774,813 | 0.09 |
| USD | 845,000 | MINERVA LUX SA 6.5% 20/09/26 REGS | 838,635 | 774,231 | 0.09 |
| USD | 820,000 | MILLICOM INTL 5.1250% 15/01/28 REGS | 824,944 | 753,170 | 0.09 |
| EUR | 700,000 | ALDESA FIN 7.25% 01/04/21 REGS | 965,300 | 748,521 | 0.09 |
| USD | 600,000 | GAZ CAP SA 8.625% 28/04/34 REGS | 684,750 | 741,910 | 0.09 |
| USD | 700,000 | INTELSAT JACK 9.7500% 15/07/25 144A | 703,405 | 740,250 | 0.09 |
| USD | 800,000 | RUMO LUX SARL 5.8750% 18/01/25 REGS | 794,352 | 732,008 | 0.09 |
| EUR | 590,000 | SCHMOLZ+BICKE 5.6250% 15/07/22 REGS | 694,127 | 692,931 | 0.08 |
| EUR | 590,000 | LSF10 WOLVERI 5.0000% 15/03/24 REGS | 732,131 | 679,585 | 0.08 |
| EUR | 590,000 | LHMC FINCO SA 6.2500% 20/12/23 REGS | 669,658 | 676,671 | 0.08 |
| USD | 650,000 | CAMELOT FINANCE 7.875% 15/10/24 144 | 651,875 | 651,625 | 0.08 |
| USD | 600,000 | ALTICE US FIN II 7.75% 15/7/25 144 | 594,825 | 625,500 | 0.07 |
| USD | 600,000 | VTB CAPITAL 6.95% 17/10/22 REGS | 573,600 | 613,212 | 0.07 |
| EUR | 600,000 | MONITCHEM HLDCO 6.875% 15/6/22 REGS | 605,939 | 612,035 | 0.07 |
| EUR | 500,000 | DUFREY FINANCE 4.5% 01/08/23 REGS | 606,957 | 600,037 | 0.07 |
| EUR | 500,000 | CIRSA FUNDING LUX 5.875% 15/5/23 RE | 543,627 | 596,618 | 0.07 |
| EUR | 565,000 | GALAPAGOS HGD 5.375% 15/06/21 REGS | 613,016 | 566,180 | 0.07 |
| EUR | 500,000 | INTRALOT CAP LUX 6.75% 15/09/21 REG | 561,900 | 545,700 | 0.06 |
| USD | 500,000 | OJSC RUSS AGRIC BK 8.5% 16/10/23 RE | 563,125 | 535,000 | 0.06 |
| USD | 520,000 | SERBANK OF RUSSIA 5.25% 23/5/23 RE | 487,887 | 515,944 | 0.06 |
| USD | 500,000 | EVRAZ GROUP 5.375% 20/03/23 REGS | 500,000 | 490,750 | 0.06 |
| USD | 526,000 | CSN RESOURCES 6.5000% 21/07/20 REGS | 480,420 | 489,838 | 0.06 |
| USD | 500,000 | MINERVA LUX S 5.8750% 19/01/28 REGS | 490,655 | 436,500 | 0.05 |
| USD | 435,000 | MHP SA 7.75% 10/05/24 REGS | 470,680 | 435,827 | 0.05 |
| USD | 430,000 | TR OP / TR FI 5.3750% 01/09/25 144A | 429,100 | 426,775 | 0.05 |
| USD | 450,000 | CSN RESOURCES 7.6250% 13/02/23 REGS | 445,424 | 406,125 | 0.05 |
| USD | 400,000 | ALTICE FINANCE 6.625% 15/02/23 REGS | 411,549 | 395,288 | 0.05 |
| USD | 400,000 | KLABIN FIN 5.25% 16/07/24 REGS | 391,403 | 388,988 | 0.05 |
| EUR | 330,000 | SAMSONITE FIN 3.5000% 15/05/26 REGS | 408,540 | 364,861 | 0.04 |
| USD | 300,000 | TELECOM ITALIA CAP 7.2% 18/07/36 | 273,388 | 310,770 | 0.04 |
| USD | 300,000 | EVRAZ GROUP 6.5% 22/04/20 REGS | 267,656 | 307,125 | 0.04 |
| USD | 300,000 | COSAN LUX 7% 20/01/27 REGS | 294,489 | 291,003 | 0.03 |
| USD | 250,000 | ALROSA FINANCE 7.75% 03/11/20 REGS | 262,188 | 268,165 | 0.03 |
| USD | 265,000 | RUMO LUXEMBOURG 7.375% 09/02/24 REG | 265,000 | 266,656 | 0.03 |
| EUR | 400,000 | GALAPAGOS HGD 7% 15/06/22 REGS | 374,494 | 261,159 | 0.03 |
| USD | 246,000 | GAZPROM 4.95% 06/02/28 REGS | 224,783 | 236,775 | 0.03 |
| USD | 225,000 | CONS ENERGY F 6.8750% 15/06/25 144A | 223,875 | 228,870 | 0.03 |
| USD | 225,000 | INTELSAT JACK 7.25% 15/10/20 GDT | 215,844 | 223,875 | 0.03 |
| USD | 212,000 | INTELSAT CONNECT 12.5% 1/04/22 144A | 191,651 | 209,350 | 0.02 |
| USD | 200,000 | FOUR FINANCE SA 10.75% 01/05/22 144 | 200,000 | 200,500 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ALTICE FIN SA 6.625% 15/02/23 144A | 204,500 | 197,100 | 0.02 |
| USD | 200,000 | LHMC FINCO SA 7.8750% 20/12/23 144A | 191,494 | 194,740 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ALTICE FINANCING 7.5% 15/05/26 144A | 200,000 | 193,440 | 0.02 |
| USD | 200,000 | TELECOM ITALIA CAP 6% 30/09/34 | 165,000 | 190,600 | 0.02 |
| USD | 200,000 | MHP LUX SA 6.9500% 03/04/26 REGS | 200,000 | 187,350 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ALTICE SA 7.625% 15/02/23 144A | 210,812 | 184,250 | 0.02 |
| USD | 200,000 | TELENET FIN L 5.5000% 01/03/28 144A | 200,000 | 182,000 | 0.02 |
| EUR | 150,000 | INTRALOT CAPI 5.2500% 15/09/24 REGS | 179,820 | 144,201 | 0.02 |
| USD | 175,000 | INTELSAT LUX 8.125% 01/06/23 | 132,770 | 141,103 | 0.02 |
| USD | 135,000 | INTELSAT JACKSON 7.5% 01/04/21 | 122,969 | 133,650 | 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 | 100,000 | MALLINCKRODT FIN 5.625% 15/10/23 14 | 86,625 | 83,000 | 0.01 |
| USD | 75,000 | INTELSAT JACK 8% 15/02/24 144A | 76,313 | 78,750 | 0.01 |
| EUR | 1,154,000 | IIB LUX 9% 06/07/11 (2) | 1,350,997 | 5,365 | 0.00 |
| | | | 53,575,909 | 51,239,014 | 5.95 |
| | | 合計：ルクセンブルグ | 62,820,427 | 60,869,437 | 7.07 |
| | | マレーシア | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 140,000 | WAKALA GLOBAL 4.646% 6/07/21 REGS | 156,926 | 144,704 | 0.02 |
| USD | 100,000 | PETRONAS CAP 7.875% 22/05/22 REGS | 132,734 | 115,003 | 0.01 |
| | | | 289,660 | 259,707 | 0.03 |
| | | 合計：マレーシア | 289,660 | 259,707 | 0.03 |
| | | マーシャル諸島 | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,170,000 | OCP SA 6.875% 25/04/44 REGS | 1,273,963 | 1,228,500 | 0.15 |
| USD | 250,000 | NAVIOS MARITIME 8.125% 15/11/21 144 | 242,625 | 204,219 | 0.02 |
| | | | 1,516,588 | 1,432,719 | 0.17 |
| 優先証券 | | | | | |
| — | 37,317 | SEASPAN CORP PFD 6.375% 30/04/19 | 933,503 | 952,703 | 0.11 |
| | | | 933,503 | 952,703 | 0.11 |
| | | 合計：マーシャル諸島 | 2,450,091 | 2,385,422 | 0.28 |
| | | モーリシャス | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 700,000 | MTN MAURITIUS 4.755% 11/11/24 REGS | 683,200 | 648,445 | 0.08 |
| | | | 683,200 | 648,445 | 0.08 |
| | | 合計：モーリシャス | 683,200 | 648,445 | 0.08 |
| | | メキシコ | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 1,720,000 | BBVA BANCOMER SA FRN 18/01/33 REGS | 1,683,219 | 1,513,617 | 0.18 |
| USD | 700,000 | GRUPO BIMBO SAB FRN 17/07/66 REGS | 700,000 | 692,125 | 0.08 |
| USD | 600,000 | BANCO MERCANT NOR FRN 04/10/31 REGS | 588,160 | 547,956 | 0.06 |
| | | | 2,971,379 | 2,753,698 | 0.32 |
| 国債 | | | | | |
| USD | 2,480,000 | UTD MEXICAN STATE 6.05% 11/01/40 | 2,976,792 | 2,750,638 | 0.33 |
| USD | 1,455,000 | UNITED MEXICAN 3.7500% 11/01/28 | 1,448,758 | 1,378,365 | 0.16 |
| USD | 298,000 | UTD MEXICAN STATES 5.75% 12/10/2110 | 312,411 | 296,482 | 0.03 |
| USD | 275,000 | UNITED MEXICAN STATE 5.55% 21/01/45 | 316,009 | 290,855 | 0.03 |
| USD | 292,000 | UNITED MEXICAN STATE 4.6% 23/01/46 | 279,250 | 270,551 | 0.03 |
| USD | 178,000 | UTD MEXICAN STATE 4.75% 8/3/44 MTN | 183,014 | 168,299 | 0.02 |
| | | | 5,516,234 | 5,155,190 | 0.60 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 200,000 | COMETA ENERGI 6.3750% 24/04/35 REGS | 196,500 | 191,940 | 0.02 |
| | | | 196,500 | 191,940 | 0.02 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 2,771,000 | PEMEX 6.75% 21/09/47 | 2,722,306 | 2,640,209 | 0.32 |
| USD | 1,310,000 | PETROLEOS MEX 5.3500% 12/02/28 REGS | 1,281,920 | 1,237,819 | 0.15 |
| USD | 1,255,000 | AXTEL SAB 6.3750% 14/11/24 REGS | 1,272,273 | 1,189,113 | 0.14 |
| EUR | 800,000 | CEMEX SAB 2.7500% 05/12/24 REGS | 965,572 | 900,959 | 0.10 |
| USD | 600,000 | MEXICHEM SAB 6.7500% 19/09/42 REGS | 682,000 | 624,000 | 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 | 600,000 | CEMEX SAB DE CV 5.7% 11/1/25 REGS | 604,500 | 592,356 | 0.07 |
| USD | 600,000 | METALSA SA 4.9% 24/04/23 REGS | 588,750 | 579,000 | 0.07 |
| USD | 525,000 | BBVA BANCOMER 6.75% 30/09/22 REGS | 579,338 | 559,524 | 0.07 |
| USD | 500,000 | CEMEX SAB DE CV 7.75% 16/04/26 REGS | 544,822 | 541,700 | 0.06 |
| USD | 565,000 | ALPHA HOLDIN 10.0000% 19/12/22 REGS | 565,000 | 522,625 | 0.06 |
| USD | 500,000 | MEXICHEM SAB DE 4.875% 19/09/22 REG | 495,130 | 506,250 | 0.06 |
| USD | 560,000 | MEXICO CITY A 5.5000% 31/07/47 REGS | 556,629 | 494,368 | 0.06 |
| USD | 475,000 | PETROLEOS MEXICA 6.5000% 13/03/27 | 507,753 | 485,925 | 0.06 |
| USD | 400,000 | CEMEX SAB DE CV 7.75% 16/04/26 144A | 401,472 | 433,360 | 0.05 |
| EUR | 360,000 | CEMEX SAB DE CV 4.375% 5/03/23 REGS | 348,118 | 433,073 | 0.05 |
| USD | 400,000 | CEMEX SAB DE CV 5.7% 11/1/25 144A | 400,000 | 394,780 | 0.05 |
| USD | 459,000 | PEMEX 5.625% 23/01/46 | 435,184 | 391,986 | 0.05 |
| USD | 350,000 | PETROLEOS MEX 6.5% 02/06/41 | 381,979 | 330,225 | 0.04 |
| USD | 300,000 | TRUST F/1401 5.25% 15/12/24 REGS | 298,650 | 296,193 | 0.03 |
| USD | 290,000 | GRUPO BIMBO S 4.5000% 25/01/22 REGS | 309,024 | 295,937 | 0.03 |
| USD | 300,000 | CREDITO REAL SA 7.25% 20/07/23 REGS | 297,978 | 295,875 | 0.03 |
| EUR | 246,000 | NEMAK SAB DE CV 3.25% 15/03/24 REGS | 259,001 | 285,511 | 0.03 |
| USD | 255,000 | GRUPO TELEvisa 6.625% 15/01/40 | 318,253 | 278,414 | 0.03 |
| USD | 222,000 | PETROLEOS MEXICAN 6.875% 4/8/26 | 226,510 | 234,383 | 0.03 |
| USD | 200,000 | COM FED DE ELEC 4.875% 15/1/24 REGS | 205,677 | 202,138 | 0.02 |
| USD | 200,000 | TRUST F/1401 6.95% 30/01/44 REGS | 198,730 | 196,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | COM FED DE ELEC 5.75% 14/02/42 REGS | 199,335 | 195,502 | 0.02 |
| USD | 178,000 | PETROLEOS MEX 4.875% 24/01/22 | 182,416 | 179,744 | 0.02 |
| USD | 137,000 | PETROLEOS MEX 5.5% 27/06/44 | 135,051 | 116,087 | 0.01 |
| | | | 15,963,371 | 15,433,056 | 1.80 |
| ワラント | | | | | |
| — | 37,375 | CORPORATION GEO SA WTS 30/12/20 | 0 | 0 | 0.00 |
| | | | 0 | 0 | 0.00 |
| | | 合計：メキシコ | 24,647,484 | 23,533,884 | 2.74 |
| | | モンゴル | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 2,665,000 | MONGOLIA INTL 5.6250% 01/05/23 REGS | 2,668,651 | 2,518,425 | 0.29 |
| | | | 2,668,651 | 2,518,425 | 0.29 |
| | | 合計：モンゴル | 2,668,651 | 2,518,425 | 0.29 |
| | | モロッコ | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 235,000 | KINGDOM OF MOROCCO 4.25% 11/12/22 R | 237,591 | 234,412 | 0.03 |
| USD | 200,000 | KINGDOM OF MOROCCO 5.5% 11/12/42 RE | 227,500 | 202,750 | 0.02 |
| | | | 465,091 | 437,162 | 0.05 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 200,000 | OFFICE CHERIFIEN 5.625% 25/04/24 RE | 214,500 | 204,466 | 0.02 |
| | | | 214,500 | 204,466 | 0.02 |
| | | 合計：モロッコ | 679,591 | 641,628 | 0.07 |
| | | オランダ | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 2,300,000 | TELEFONICA EUROPE FRN 31/03/49 | 2,814,360 | 2,919,314 | 0.33 |
| EUR | 1,400,000 | TELEFONICA EUROPE FRN 29/09/49 | 1,855,561 | 1,866,943 | 0.22 |
| EUR | 900,000 | TELEFONICA EUROPE FRN 22/09/66 | 1,095,867 | 963,033 | 0.11 |
| EUR | 640,000 | NN GROUP NV FRN 29/06/49 EMTN | 869,608 | 768,165 | 0.09 |
| EUR | 500,000 | VOLKSWAGEN INTFN FRN 14/06/66 | 563,125 | 556,451 | 0.06 |
| EUR | 400,000 | REPSOL INTL FIN 4.5% 25/03/75 | 417,621 | 485,841 | 0.06 |
| EUR | 400,000 | VOLKSWAGEN INTFN FRN 27/06/67 | 462,740 | 461,693 | 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(%) |
|-------------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| EUR | 280,000 | IPD 3 BV FRN 15/07/22 REGS | 322,182 | 328,540 | 0.04 |
| EUR | 280,000 | ASR NEDERLAND NV FRN 19/04/66 | 332,486 | 309,994 | 0.04 |
| EUR | 130,000 | HEMA BONDCO I FRN 15/07/22 REGS | 147,285 | 144,704 | 0.02 |
| EUR | 100,000 | TELEFONICA EUROP FRN 04/12/66 NC5 | 110,452 | 108,835 | 0.01 |
| | | | 8,991,287 | 8,913,513 | 1.03 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 650,000 | MINEJESA CAPI 4.6250% 10/08/30 REGS | 654,500 | 590,625 | 0.07 |
| | | | 654,500 | 590,625 | 0.07 |
| ベイ・イン・カインド(PIK)債 | | | | | |
| USD | 400,000 | ALPHA 2 BV PIK 01/06/23 144A | 396,020 | 398,000 | 0.05 |
| | | | 396,020 | 398,000 | 0.05 |
| ステップアップ/ダウン債 | | | | | |
| EUR | 350,000 | RABOBANK STICHT STUP 29/12/49 | 495,828 | 482,853 | 0.06 |
| | | | 495,828 | 482,853 | 0.06 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 4,000,000 | PETROBRAS GLOB 5.7500% 01/02/29 | 3,936,081 | 3,516,520 | 0.42 |
| EUR | 3,500,000 | TEVA PHARM FNC NL 1.125% 15/10/24 | 3,608,514 | 3,440,554 | 0.41 |
| USD | 3,698,000 | PETROBRAS GLO 5.9990% 27/01/28 REGS | 3,576,242 | 3,367,029 | 0.40 |
| EUR | 1,800,000 | PETROBRAS GBL FIN 4.75% 14/01/25 | 1,838,348 | 2,150,931 | 0.25 |
| EUR | 1,630,000 | OI EUROPEAN GRP 3.125% 15/11/24 REG | 1,763,602 | 1,910,444 | 0.22 |
| EUR | 1,600,000 | INTERXION HOL 4.7500% 15/06/25 REGS | 1,892,577 | 1,866,375 | 0.22 |
| USD | 1,570,000 | PETROBRAS GBL FIN 8.75% 23/05/26 | 1,820,663 | 1,703,921 | 0.20 |
| USD | 1,630,000 | PETROBRAS GBL FIN 6.85% 05/06/2115 | 1,447,036 | 1,370,423 | 0.16 |
| EUR | 1,050,000 | OI EUROPEAN GRP 4.875% 31/3/21 REGS | 1,360,380 | 1,340,894 | 0.16 |
| USD | 1,399,000 | WMPELCOM HLD 4.9500% 16/06/24 REGS | 1,414,935 | 1,322,755 | 0.15 |
| USD | 1,170,000 | KAZAKHSTAN TEMIR 6.95% 10/7/42 REGS | 1,317,174 | 1,265,004 | 0.15 |
| EUR | 1,000,000 | LGE HOLDCO VI 7.125% 15/05/24 REGS | 1,198,383 | 1,244,591 | 0.14 |
| USD | 1,190,000 | TEVA PHARMACEUTI 6.7500% 01/03/28 | 1,200,261 | 1,214,351 | 0.14 |
| EUR | 1,000,000 | NYRSTAR NETHER HD 8.5% 15/09/19 REG | 1,136,852 | 1,183,226 | 0.14 |
| USD | 1,165,000 | VTR FIN 6.875% 15/01/24 REGS | 1,202,147 | 1,177,023 | 0.14 |
| EUR | 1,060,000 | SIGMA HOLDCO 5.7500% 15/05/26 REGS | 1,294,536 | 1,152,818 | 0.13 |
| EUR | 1,000,000 | ZIGGO SEC 3.75% 15/1/25 REGS | 1,116,570 | 1,146,144 | 0.13 |
| USD | 1,395,000 | TEVA PHARMACEUTICALS 3.15% 01/10/26 | 1,156,525 | 1,119,634 | 0.13 |
| EUR | 1,000,000 | NYRSTAR NETHER HD 6.875% 15/3/24 RE | 1,050,494 | 1,078,568 | 0.13 |
| EUR | 910,000 | UNITED GROUP 4.3750% 01/07/22 REGS | 1,040,676 | 1,076,202 | 0.13 |
| USD | 1,015,000 | TEVA PHARMACEUTICALS 2.8% 21/07/23 | 897,838 | 874,961 | 0.10 |
| EUR | 670,000 | TEVA PHARM FNC 4.5000% 01/03/25 WI | 832,040 | 797,235 | 0.09 |
| EUR | 690,000 | SUNSHINE MID 6.5000% 15/05/26 REGS | 830,820 | 759,081 | 0.09 |
| EUR | 625,000 | LKQ EURO BV 3.6250% 01/04/26 REGS | 772,125 | 716,057 | 0.08 |
| EUR | 610,000 | ZIGGO SEC 4.25% 15/01/27 REGS | 711,081 | 699,258 | 0.08 |
| EUR | 620,000 | MAXEDA DIY 6.1250% 15/07/22 REGS | 709,032 | 654,869 | 0.08 |
| USD | 600,000 | MARFRIG HLDG EUR 8% 08/06/23 REGS | 592,140 | 607,500 | 0.07 |
| USD | 600,000 | VTR FIN 6.875% 15/01/24 144A | 600,000 | 602,820 | 0.07 |
| EUR | 500,000 | SELECTA GROUP 5.8750% 01/02/24 REGS | 612,850 | 566,540 | 0.07 |
| EUR | 460,000 | TEVA PHARM FNC 3.2500% 15/04/22 WI | 571,251 | 542,446 | 0.06 |
| EUR | 440,000 | DIGI COMM NV 5% 15/10/23 REGS | 486,068 | 534,477 | 0.06 |
| EUR | 500,000 | TEVA PHARM FNC NL II 1.25% 31/03/23 | 530,452 | 527,502 | 0.06 |
| EUR | 440,000 | GRUPO ANTOLIN DUT 5.125% 30/6/22 RE | 496,892 | 524,517 | 0.06 |
| USD | 500,000 | LUKOIL INTL FIN 6.125% 9/11/20 * | 543,134 | 523,750 | 0.06 |
| EUR | 500,000 | DIAMOND BC BV 5.6250% 15/08/25 REGS | 583,025 | 520,827 | 0.06 |
| USD | 515,000 | SIGMA FIN NL 4.8750% 27/03/28 REGS | 511,580 | 491,825 | 0.06 |
| USD | 500,000 | MARFRIG HDGS EUR 7% 15/03/24 REGS | 493,230 | 480,625 | 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(%) |
|-------------|----------------------------|-------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------|
| USD | 500,000 | METINVEST BV 7.7500% 23/04/23 REGS | 495,070 | 469,500 | 0.05 |
| USD | 460,000 | CONSTELLUM NV 6.625% 01/03/25 144A | 458,661 | 463,450 | 0.05 |
| USD | 380,000 | SIGMA HOLDCO 7.8750% 15/05/26 144A | 380,000 | 357,200 | 0.04 |
| EUR | 300,000 | GOODYEAR DUNLOP 3.75% 15/12/23 REGS | 353,009 | 356,797 | 0.04 |
| EUR | 270,000 | IPD 3 BV 4.5000% 15/07/22 REGS | 316,584 | 317,634 | 0.04 |
| USD | 300,000 | LUKOIL INTL FIN 4.75% 02/11/26 REGS | 300,000 | 297,000 | 0.03 |
| USD | 230,000 | GTH FINANCE B 7.2500% 26/04/23 REGS | 245,415 | 238,068 | 0.03 |
| EUR | 200,000 | OCI NV 5.0000% 15/04/23 REGS | 247,690 | 237,067 | 0.03 |
| USD | 200,000 | ALCOA NEDERLAND HDG 7% 30/09/26 144 | 200,000 | 213,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | MYRIAD INTL HDGS 5.5% 21/07/25 REGS | 199,924 | 205,747 | 0.02 |
| USD | 200,000 | GTH FINANCE BV 6.25% 26/04/20 144A | 200,000 | 203,500 | 0.02 |
| USD | 200,000 | NXP BV/NXP FD 4.625% 15/06/22 144A | 215,000 | 202,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | NXP BV/NXP FD 4.125% 01/06/21 144A | 210,750 | 200,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | BHARTI AIRTEL ITL 5.125% 11/3/23 RE | 199,430 | 197,591 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ALPHA 3 BV US BID 6.25% 01/02/25 14 | 200,000 | 196,500 | 0.02 |
| EUR | 170,000 | EAGLE INT/RUY 5.3750% 01/05/23 REGS | 209,780 | 195,951 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ZIGGO BONG FIN 5.875% 15/01/25 144A | 200,000 | 186,878 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ZIGGO BOND FIN 6% 15/01/27 144A | 198,214 | 184,750 | 0.02 |
| EUR | 150,000 | UPC HOLDING B 3.8750% 15/06/29 REGS | 171,594 | 161,457 | 0.02 |
| USD | 125,000 | OI EUROPEAN G 4.0000% 15/03/23 144A | 119,375 | 116,563 | 0.01 |
| USD | 50,000 | CLEAR CHANNEL 8.7500% 15/12/20 144A | 52,000 | 51,688 | 0.01 |
| | | | <u>50,318,050</u> | <u>49,124,038</u> | <u>5.71</u> |
| | | 合計：オランダ | <u>60,855,685</u> | <u>59,509,029</u> | <u>6.92</u> |
| | | ナイジェリア | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 510,000 | REP OF NIGERI 7.6960% 23/02/38 REGS | 510,000 | 481,950 | 0.05 |
| USD | 350,000 | REP OF NIGERI 7.1430% 23/02/30 REGS | <u>350,000</u> | <u>329,875</u> | <u>0.04</u> |
| | | | 860,000 | 811,825 | 0.09 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 640,000 | REP OF NIGERI 7.6250% 28/11/47 REGS | 640,000 | 582,786 | 0.07 |
| USD | 270,000 | REP OF NIGERI 6.5000% 28/11/27 REGS | <u>270,000</u> | <u>250,903</u> | <u>0.03</u> |
| | | | <u>910,000</u> | <u>833,689</u> | <u>0.10</u> |
| | | 合計：ナイジェリア | <u>1,770,000</u> | <u>1,645,514</u> | <u>0.19</u> |
| | | ノルウェー | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 390,000 | DNB BANK ASA FRN 29/12/49 | <u>390,000</u> | <u>398,287</u> | <u>0.04</u> |
| | | | 390,000 | 398,287 | 0.04 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 150,000 | AKER BP ASA 5.8750% 31/03/25 144A | <u>150,000</u> | <u>154,463</u> | <u>0.02</u> |
| | | | <u>150,000</u> | <u>154,463</u> | <u>0.02</u> |
| | | 合計：ノルウェー | <u>540,000</u> | <u>552,750</u> | <u>0.06</u> |
| | | オマーン | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 350,000 | OMAN INTRNL B 6.7500% 17/01/48 REGS | <u>345,786</u> | <u>317,090</u> | <u>0.04</u> |
| | | | <u>345,786</u> | <u>317,090</u> | <u>0.04</u> |
| | | 合計：オマーン | <u>345,786</u> | <u>317,090</u> | <u>0.04</u> |
| | | パキスタン | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 1,559,000 | REP OF PAKIST 6.8750% 05/12/27 REGS | 1,555,661 | 1,348,534 | 0.15 |
| USD | 424,000 | ISLAMIC REP PAKIST 8.25% 15/4/24 R | 459,520 | 407,210 | 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 | 320,000 | ISLAMIC REP PAKIST 6.75% 3/12/19 RE | 320,000 | 313,262 | 0.04 |
| USD | 200,000 | ISLAMIC REP PAKIST 8.25% 30/9/25 RE | 200,000 | 191,342 | 0.02 |
| | | | <u>2,535,181</u> | <u>2,260,348</u> | <u>0.26</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 200,000 | THRD PKSTN SU 5.6250% 05/12/22 REGS | 200,000 | 180,216 | 0.02 |
| | | | <u>200,000</u> | <u>180,216</u> | <u>0.02</u> |
| | | 合計：パキスタン | <u>2,735,181</u> | <u>2,440,564</u> | <u>0.28</u> |
| パナマ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 500,000 | REP PANAMA 3.75% 16/03/25 | 507,750 | 494,500 | 0.06 |
| USD | 25,000 | REP OF PANAMA 8.875% 30/09/27 | 37,435 | 33,588 | 0.00 |
| | | | <u>545,185</u> | <u>528,088</u> | <u>0.06</u> |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 280,000 | REP OF PANAMA 4.3% 29/04/53 | 266,500 | 262,150 | 0.03 |
| USD | 90,000 | REP OF PANAMA 6.7% 26/01/36 | 115,859 | 110,445 | 0.01 |
| | | | <u>382,359</u> | <u>372,595</u> | <u>0.04</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 400,000 | MULTIBANK INC 4.3750% 09/11/22 REGS | 399,824 | 390,499 | 0.06 |
| USD | 310,000 | INTERCORP FIN 4.1250% 19/10/27 REGS | 307,542 | 284,735 | 0.03 |
| USD | 200,000 | BANISTMO SA 3.6500% 19/09/22 REGS | 188,500 | 188,500 | 0.02 |
| | | | <u>895,866</u> | <u>863,734</u> | <u>0.11</u> |
| | | 合計：パナマ | <u>1,823,410</u> | <u>1,764,417</u> | <u>0.21</u> |
| パラグアイ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 320,000 | REPUBLIC OF P 5.6000% 13/03/48 REGS | 320,000 | 312,000 | 0.04 |
| USD | 200,000 | REP OF PARAGUAY 4.625% 25/01/23 REG | 205,900 | 202,340 | 0.02 |
| | | | <u>525,900</u> | <u>514,340</u> | <u>0.06</u> |
| | | 合計：パラグアイ | <u>525,900</u> | <u>514,340</u> | <u>0.06</u> |
| ペルー | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 500,000 | BANCO INTL PERU FRN 23/04/70 REGS | 514,250 | 532,590 | 0.06 |
| | | | <u>514,250</u> | <u>532,590</u> | <u>0.06</u> |
| 国債 | | | | | |
| USD | 218,000 | REP OF PERU 5.625% 18/11/50 | 268,417 | 253,011 | 0.03 |
| USD | 150,000 | REP OF PERU 7.35% 21/07/25 | 205,397 | 183,240 | 0.02 |
| USD | 102,000 | REP OF PERU 8.75% 21/11/33 | 158,084 | 149,395 | 0.02 |
| | | | <u>631,898</u> | <u>585,646</u> | <u>0.07</u> |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 1,165,000 | PERU LNG SRL 5.3750% 22/03/30 REGS | 1,162,480 | 1,151,894 | 0.13 |
| USD | 550,000 | FENIX POWER P 4.3170% 20/09/27 REGS | 550,000 | 516,175 | 0.06 |
| | | | <u>1,712,480</u> | <u>1,668,069</u> | <u>0.19</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 630,000 | VOLCAN CIA MINE 5.375% 02/02/22 | 647,843 | 641,780 | 0.08 |
| USD | 450,000 | PETROLEOS DEL 4.7500% 19/06/32 REGS | 450,000 | 431,099 | 0.05 |
| USD | 400,000 | BANCO CRED PERU 5.375% 16/09/20 REGS | 387,000 | 415,400 | 0.05 |
| USD | 350,000 | INRETAIL SHOP 5.7500% 03/04/28 REGS | 350,000 | 345,800 | 0.04 |
| USD | 250,000 | UNION AND CEMENT 5.875% 30/10/21 RE | 250,000 | 256,008 | 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 | 258,000 | GAS NATURAL LIMA 4.375% 1/4/23 REGS | 265,895 | 254,453 | 0.03 |
| USD | 200,000 | PETROLEOS DEL 5.6250% 19/06/47 REGS | 200,000 | 195,180 | 0.02 |
| USD | 150,000 | MINSUR SA 6.25% 07/02/24 REGS | 162,563 | 157,481 | 0.02 |
| | | 合計：ペルー | 2,713,301 | 2,697,201 | 0.32 |
| | | | 5,571,929 | 5,483,506 | 0.64 |
| | | フィリピン | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 550,000 | REP OF PHILIPPINES 3.95% 20/01/40 | 568,975 | 527,312 | 0.07 |
| USD | 370,000 | REP OF PHILIPPINES 5.5% 30/03/26 | 453,250 | 407,000 | 0.05 |
| USD | 177,000 | REP OF PHILIPPINES 7.75% 14/01/31 | 260,927 | 233,198 | 0.03 |
| USD | 151,000 | REP OF PHILIPPINES 6.375% 23/10/34 | 206,155 | 184,409 | 0.02 |
| USD | 90,000 | REP OF PHILIPPINES 10.625% 16/03/25 | 140,776 | 125,325 | 0.01 |
| USD | 18,000 | REP OF PHILIPPINES 9.5% 02/02/30 | 29,748 | 26,235 | 0.00 |
| | | | 1,659,831 | 1,503,479 | 0.18 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 350,000 | NATIONAL POWER 9.625% 15/05/28 | 437,636 | 486,937 | 0.06 |
| USD | 200,000 | DEV BK PHILIPPINES 5.5% 25/03/21 | 226,750 | 209,734 | 0.02 |
| | | 合計：フィリピン | 664,386 | 696,671 | 0.08 |
| | | | 2,324,217 | 2,200,150 | 0.26 |
| | | ポルトガル | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 600,000 | CAIXA GERAL DE DEPO 10.75% 31/12/49 | 699,529 | 766,246 | 0.09 |
| | | | 699,529 | 766,246 | 0.09 |
| | | 合計：ポルトガル | 699,529 | 766,246 | 0.09 |
| | | カタール | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 200,000 | QATAR STATE O 5.1030% 23/04/48 REGS | 200,000 | 199,498 | 0.03 |
| | | | 200,000 | 199,498 | 0.03 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 17,000 | RAS LAFFAN LNG 6.332% 30/09/27 REGS | 18,060 | 18,551 | 0.00 |
| | | | 18,060 | 18,551 | 0.00 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 200,000 | CBQ FINANCE LTD 2.875% 24/06/19 | 198,700 | 198,788 | 0.02 |
| | | | 198,700 | 198,788 | 0.02 |
| | | 合計：カタール | 416,760 | 416,837 | 0.05 |
| | | 韓国 | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 980,000 | WOORI BANK FRN 29/12/49 REGS | 980,000 | 931,598 | 0.11 |
| | | | 980,000 | 931,598 | 0.11 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 250,000 | KOREA GAS CORP 3.5% 21/07/25 REGS | 268,375 | 242,770 | 0.03 |
| | | | 268,375 | 242,770 | 0.03 |
| | | 合計：韓国 | 1,248,375 | 1,174,368 | 0.14 |

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(%) |
|---------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| ルーマニア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 130,000 | ROMANIA GVT 4.375% 22/08/23 REGS | 132,437 | 130,975 | 0.02 |
| | | | 132,437 | 130,975 | 0.02 |
| | | 合計：ルーマニア | 132,437 | 130,975 | 0.02 |
| ロシア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 2,200,000 | RUSSIA-EUROBO 4.3750% 21/03/29 REGS | 2,126,694 | 2,128,500 | 0.25 |
| USD | 200,000 | RUSSIAN FED 5.875% 16/09/43 REGS | 189,725 | 215,250 | 0.03 |
| USD | 200,000 | RUSSIA-EUROBOND 5.2500% 23/06/47 | 201,500 | 193,000 | 0.02 |
| | | | 2,517,919 | 2,536,750 | 0.30 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 5,640 | RUSSIAN FED FRN 31/03/30 REGS | 3,027 | 2,761 | 0.00 |
| | | | 3,027 | 2,761 | 0.00 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 950,000 | CREDIT BK MOSCOW 5.875% 7/11/21 REG | 988,001 | 928,339 | 0.11 |
| USD | 600,000 | GAZPROMBK OJSC 7.25% 03/05/19 EMTN | 603,750 | 611,153 | 0.07 |
| USD | 590,000 | GAZPROM 4.375% 19/09/22 REGS | 510,286 | 575,988 | 0.07 |
| USD | 200,000 | SEVERSTAL OAO 5.9% 17/10/22 REGS | 200,800 | 207,750 | 0.02 |
| USD | 200,000 | STEEL FUNDING 4.5% 15/06/23 REGS | 200,000 | 194,000 | 0.02 |
| USD | 85,000 | GAZPROM OAO 7.288% 16/08/37 REGS | 85,894 | 96,050 | 0.01 |
| | | | 2,588,731 | 2,613,280 | 0.30 |
| | | 合計：ロシア | 5,109,677 | 5,152,791 | 0.60 |
| セネガル | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 420,000 | SENEGAL REP O 6.7500% 13/03/48 REGS | 420,000 | 358,050 | 0.04 |
| | | | 420,000 | 358,050 | 0.04 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 200,000 | REP OF SENEGAL 6.25% 23/05/33 REGS | 200,000 | 177,250 | 0.02 |
| | | | 200,000 | 177,250 | 0.02 |
| | | 合計：セネガル | 620,000 | 535,300 | 0.06 |
| シンガポール | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 300,000 | DBS GROUP HOLDINGS FRN 29/12/49 GMT | 300,870 | 286,364 | 0.03 |
| | | | 300,870 | 286,364 | 0.03 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,200,000 | ABJA INVESTMENT 5.4500% 24/01/28 | 1,200,000 | 1,015,509 | 0.12 |
| | | | 1,200,000 | 1,015,509 | 0.12 |
| | | 合計：シンガポール | 1,500,870 | 1,301,873 | 0.15 |
| 南アフリカ | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 700,000 | BARCLAYS AFRICA FRN 25/04/28 | 695,940 | 677,250 | 0.08 |
| | | | 695,940 | 677,250 | 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(%) |
|--------------------|----------------------------|---|------------------|------------------|-------------|
| 国債 | | | | | |
| USD | 840,000 | REP OF SOUTH AFRICA 4.875% 14/04/26 | 843,741 | 806,400 | 0.10 |
| USD | 700,000 | SOUTH AFRICA 6.2500% 08/03/41 | 763,458 | 691,250 | 0.08 |
| USD | 300,000 | SOUTH AFRICA 6.3000% 22/06/48 | 304,200 | 290,574 | 0.03 |
| USD | 326,000 | REP OF STH AFRICA 5% 12/10/46 | 313,615 | 270,988 | 0.03 |
| USD | 295,000 | REP OF SOUTH AFRICA 4.3% 12/10/28 | 288,593 | 263,288 | 0.03 |
| USD | 270,000 | SOUTH AFRICA 5.6500% 27/09/47 | 270,000 | 243,215 | 0.03 |
| USD | 200,000 | SOUTH AFRICA 5.8750% 22/06/30 | 199,984 | 198,292 | 0.02 |
| USD | 110,000 | REP OF STH AFRICA 5.875% 30/05/22 | 122,218 | 114,950 | 0.01 |
| | | | <u>3,105,809</u> | <u>2,878,957</u> | <u>0.33</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 800,000 | GROWTHPOINT 5.8720% 02/05/23 REGS | 806,249 | 811,790 | 0.10 |
| USD | 845,000 | ESKOM HLDG 7.125% 11/02/25 REGS | 849,938 | 806,130 | 0.09 |
| USD | 300,000 | ESKOM HLDG 6.75% 06/08/23 REGS | 282,940 | 287,208 | 0.03 |
| USD | 254,000 | ESKOM HLDG 5.75% 26/01/21 REGS | 224,346 | 245,127 | 0.03 |
| | | | <u>2,163,473</u> | <u>2,150,255</u> | <u>0.25</u> |
| | | 合計：南アフリカ | <u>5,965,222</u> | <u>5,706,462</u> | <u>0.66</u> |
| スペイン | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 1,400,000 | CAIXABANK FRN 14/07/28 EMTN | 1,646,764 | 1,647,903 | 0.19 |
| EUR | 1,020,000 | NAVIERA ARMAS SA FRN 31/07/23 REGS | 1,117,208 | 1,187,317 | 0.14 |
| EUR | 700,000 | BANKIA SA FRN 15/03/27 | 808,841 | 828,255 | 0.10 |
| EUR | 600,000 | BANKINTER SA 2.5% 06/04/27 | 642,635 | 699,919 | 0.08 |
| EUR | 600,000 | BANCO DE SABADELL FRN 29/12/49 | 738,201 | 696,543 | 0.08 |
| EUR | 500,000 | BANKIA SA FRN 22/05/24 MTN | 541,295 | 593,499 | 0.07 |
| EUR | 300,000 | NAVIERA ARMAS SA FRN 15/11/24 REGS | 349,260 | 342,208 | 0.04 |
| | | | <u>5,844,204</u> | <u>5,995,644</u> | <u>0.70</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 1,000,000 | CELLNEX TELECOM 2.375% 16/01/24 EMT | 1,124,189 | 1,165,678 | 0.14 |
| EUR | 810,000 | GESTAMP AUTOM 3.2500% 30/04/26 REGS | 975,971 | 897,920 | 0.10 |
| EUR | 460,000 | NH HOTEL GROUP SA 3.75% 1/10/23 REG | 511,855 | 555,376 | 0.06 |
| EUR | 200,000 | CELLNEX TELECOM SA 2.875% 18/04/25 EMTN | 209,838 | 234,924 | 0.03 |
| EUR | 200,000 | GRIFOLS SA 3.2% 01/05/25 REGS | 238,516 | 227,383 | 0.03 |
| | | | <u>3,060,369</u> | <u>3,081,281</u> | <u>0.36</u> |
| | | 合計：スペイン | <u>8,904,573</u> | <u>9,076,925</u> | <u>1.06</u> |
| スリランカ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 200,000 | REP OF SRI LANKA 6.825% 18/07/26 RE | 200,000 | 191,500 | 0.02 |
| | | | <u>200,000</u> | <u>191,500</u> | <u>0.02</u> |
| | | 合計：スリランカ | <u>200,000</u> | <u>191,500</u> | <u>0.02</u> |
| スリナム | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 230,000 | REP OF SURINAME 9.25% 26/10/26 REGS | 228,850 | 219,650 | 0.03 |
| | | | <u>228,850</u> | <u>219,650</u> | <u>0.03</u> |
| | | 合計：スリナム | <u>228,850</u> | <u>219,650</u> | <u>0.03</u> |
| スウェーデン | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 1,760,000 | SVENSKA HANDEL FRN 29/12/49 | 1,760,328 | 1,704,979 | 0.19 |
| EUR | 570,000 | AKELIUS RESIDENT FRN 05/10/78 | 707,365 | 645,948 | 0.08 |
| | | | <u>2,467,693</u> | <u>2,350,927</u> | <u>0.27</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 | | | | | |
| EUR | 1,939,000 | VERISURE HDG 6% 01/11/22 REGS | 1,954,962 | 2,109,666 | 0.24 |
| EUR | 1,300,000 | PERSTORP HOLD 7.6250% 30/06/21 REGS | 1,107,363 | 1,270,264 | 0.15 |
| | | | 3,062,325 | 3,379,930 | 0.39 |
| バイ・イン・カインド(PIK)債 | | | | | |
| EUR | 1,400,000 | CORRAL PETROL PIK 11.75% 15/5/21 RE | 1,552,768 | 1,708,256 | 0.20 |
| | | | 1,552,768 | 1,708,256 | 0.20 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 2,690,000 | VERISURE MIDH 5.7500% 01/12/23 REGS | 3,172,181 | 3,030,226 | 0.36 |
| EUR | 1,400,000 | TRANSCOM HOLDING 6.5000% 22/03/23 | 1,733,409 | 1,562,131 | 0.18 |
| EUR | 240,000 | UNILABS SUB 5.75% 15/05/25 REGS | 286,171 | 265,247 | 0.03 |
| EUR | 100,000 | VOLVO CAR AB 2.0000% 24/01/25 EMTN | 123,726 | 112,394 | 0.01 |
| | | | 5,315,487 | 4,969,998 | 0.58 |
| | | 合計：スウェーデン | 12,398,273 | 12,409,111 | 1.44 |
| 変動金利債 | | | | | |
| スイス | | | | | |
| USD | 890,000 | CREDIT SUISSE GR FRN 29/12/49 | 890,000 | 906,243 | 0.10 |
| USD | 500,000 | UBS GROUP FUNDIN FRN 31/01/67 | 500,000 | 438,750 | 0.05 |
| USD | 400,000 | CREDIT SUISSE GR FRN 29/12/49 144A | 383,000 | 392,052 | 0.05 |
| | | | 1,773,000 | 1,737,045 | 0.20 |
| | | 合計：スイス | 1,773,000 | 1,737,045 | 0.20 |
| 変動金利債 | | | | | |
| タイ | | | | | |
| USD | 800,000 | PTTEP TREASURY FRN 17/01/66 REGS | 800,000 | 751,963 | 0.09 |
| | | | 800,000 | 751,963 | 0.09 |
| | | 合計：タイ | 800,000 | 751,963 | 0.09 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| トリニダード・トバゴ | | | | | |
| USD | 600,000 | PETRO CO TRIN/TOBA 9.75% 14/08/19 R | 639,875 | 616,200 | 0.07 |
| | | | 639,875 | 616,200 | 0.07 |
| | | 合計：トリニダード・トバゴ | 639,875 | 616,200 | 0.07 |
| 国債 | | | | | |
| トルコ | | | | | |
| USD | 3,900,000 | TURKEY REP OF 6.1250% 24/10/28 | 3,792,497 | 3,656,249 | 0.42 |
| USD | 1,591,000 | REP OF TURKEY 6.875% 17/03/36 | 1,779,805 | 1,499,517 | 0.17 |
| USD | 350,000 | REP OF TURKEY 4.875% 16/04/43 | 322,585 | 260,750 | 0.03 |
| USD | 285,000 | TURK EXIMBANK 4.2500% 18/09/22 REGS | 283,099 | 253,918 | 0.03 |
| USD | 230,000 | REP OF TURKEY 5.75% 22/03/24 | 246,301 | 221,950 | 0.03 |
| USD | 210,000 | REP OF TURKEY 7.375% 05/02/25 | 250,730 | 217,088 | 0.03 |
| USD | 200,000 | REP OF TURKEY 6.25% 26/09/22 | 222,302 | 200,750 | 0.02 |
| USD | 210,000 | REP OF TURKEY 6.75% 30/05/40 | 242,118 | 192,150 | 0.02 |
| USD | 180,000 | REP OF TURKEY 7.5% 07/11/19 | 216,212 | 184,725 | 0.02 |
| USD | 144,000 | REP OF TURKEY 5.625% 30/03/21 | 159,813 | 143,280 | 0.02 |
| USD | 140,000 | REP OF TURKEY 7% 11/03/19 | 166,527 | 141,750 | 0.02 |
| USD | 130,000 | REP OF TURKEY 7% 05/06/20 | 148,995 | 133,088 | 0.02 |
| USD | 40,000 | REP OF TURKEY 7.25% 05/03/38 | 48,400 | 39,050 | 0.00 |
| | | | 7,879,384 | 7,144,265 | 0.83 |

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) | | | | | |
| EUR | 1,000,000 | TURKIYE VAKIFLAR 3.5% 17/06/19 EMTN | 1,117,890 | 1,158,800 | 0.14 |
| USD | 500,000 | IS BANKASI 6.1250% 25/04/24 REGS | 510,085 | 454,781 | 0.05 |
| USD | 440,000 | PETKIM PETROK 5.8750% 26/01/23 REGS | 437,655 | 399,780 | 0.05 |
| USD | 295,000 | TURKIYE VAKIFLAR 5.5% 27/10/21 REGS | 294,528 | 272,810 | 0.03 |
| USD | 215,000 | YAPI KREDI BA 6.1000% 16/03/23 REGS | 215,000 | 201,025 | 0.02 |
| USD | 200,000 | TURKIYE IS BANK 5.375% 6/10/21 REGS | 199,080 | 185,766 | 0.02 |
| | | | <u>2,774,238</u> | <u>2,672,962</u> | <u>0.31</u> |
| | | 合計：トルコ | <u>10,653,622</u> | <u>9,817,227</u> | <u>1.14</u> |
| ウクライナ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 1,815,000 | UKRAINE GOVT 7.3750% 25/09/32 REGS | 1,806,686 | 1,556,363 | 0.18 |
| USD | 1,000,000 | UKRAINE GVT 7.75% 01/09/27 REGS | 1,035,877 | 916,000 | 0.11 |
| USD | 670,000 | UKRAINE GVT 7.75% 01/09/24 REGS | 639,300 | 633,552 | 0.07 |
| USD | 495,000 | UKRAINE GVT 7.75% 01/09/21 REGS | 452,309 | 487,575 | 0.06 |
| USD | 450,000 | UKRAINE GVT 7.75% 01/09/23 REGS | 432,270 | 433,125 | 0.05 |
| USD | 200,000 | UKRAINE GVT 7.75% 01/09/22 REGS | 193,320 | 195,100 | 0.02 |
| USD | 151,000 | UKRAINE GVT 7.75% 01/09/26 REGS | 155,530 | 139,708 | 0.02 |
| USD | 100,000 | UKRAINE GVT 7.75% 01/09/25 REGS | 96,500 | 93,573 | 0.01 |
| | | | <u>4,811,792</u> | <u>4,454,996</u> | <u>0.52</u> |
| | | 合計：ウクライナ | <u>4,811,792</u> | <u>4,454,996</u> | <u>0.52</u> |
| アラブ首長国連邦 | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 200,000 | NBK TIER 1 FNC LTD FRN 29/12/49 | 208,126 | 200,550 | 0.03 |
| USD | 200,000 | FIRST ABU DHABI FRN 29/12/49 REGS | 202,000 | 199,180 | 0.02 |
| | | | <u>410,126</u> | <u>399,730</u> | <u>0.05</u> |
| 国債 | | | | | |
| USD | 200,000 | OMAN GVT INTL 6.5% 08/03/47 REGS | 200,985 | 179,130 | 0.02 |
| | | | <u>200,985</u> | <u>179,130</u> | <u>0.02</u> |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 610,000 | ACWA POW MGMT INV 5.95% 15/12/39 RE | 621,360 | 596,397 | 0.07 |
| | | | <u>621,360</u> | <u>596,397</u> | <u>0.07</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 800,000 | ABU DHABI NTL NRG 4.375% 22/6/26 RE | 792,016 | 789,000 | 0.09 |
| USD | 700,000 | OZTEL HLDG SP 6.6250% 24/04/28 REGS | 679,965 | 665,235 | 0.08 |
| USD | 550,000 | TAQA ABU DHAB 4.8750% 23/04/30 REGS | 549,753 | 548,625 | 0.06 |
| USD | 500,000 | ABU DHABI NTL NRG 3.625% 22/6/21 RE | 498,300 | 499,002 | 0.06 |
| USD | 300,000 | DP WORLD 6.85% 02/07/37 REGS | 249,830 | 342,000 | 0.04 |
| USD | 300,000 | OZTEL HLDG SP 5.6250% 24/10/23 REGS | 296,517 | 294,134 | 0.03 |
| USD | 200,000 | TAQA ABU DHAB 4.3750% 23/04/25 REGS | 198,000 | 197,813 | 0.02 |
| | | | <u>3,264,381</u> | <u>3,335,809</u> | <u>0.38</u> |
| | | 合計：アラブ首長国連邦 | <u>4,496,852</u> | <u>4,511,066</u> | <u>0.52</u> |
| イギリス | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| GBP | 1,000,000 | LLOYDS BANK FRN 29/01/49 EMTN * | 1,840,600 | 2,314,333 | 0.27 |
| EUR | 1,000,000 | HSBC HOLDINGS FRN 29/12/49 | 1,079,562 | 1,223,914 | 0.14 |
| USD | 1,075,000 | BARCLAYS BK PLC FRN 29/12/49 | 1,106,406 | 1,094,393 | 0.13 |
| EUR | 800,000 | BARCLAYS BK PLC FRN 15/06/49 | 778,495 | 957,030 | 0.11 |
| GBP | 660,000 | AVIVA PLC FRN 29/09/49 | 926,253 | 946,224 | 0.11 |
| EUR | 600,000 | BARCLAYS PLC FRN 07/02/28 EMTN | 711,472 | 666,528 | 0.08 |

| 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 | 400,000 | ROYAL BK SCOTLAND FRN 29/12/49 | 403,000 | 425,100 | 0.05 |
| USD | 400,000 | RBS FRN 29/12/49 | 400,000 | 420,000 | 0.05 |
| USD | 400,000 | RBS FRN 29/12/49 | 400,000 | 407,800 | 0.05 |
| USD | 300,000 | HSBC HOLDINGS FRN 23/09/66 | 300,000 | 294,000 | 0.03 |
| EUR | 200,000 | ALGECO SCOTSMAN FRN 15/02/23 REGS | 242,511 | 233,332 | 0.03 |
| USD | 125,000 | RBS FRN 29/03/49 U | 97,734 | 120,894 | 0.01 |
| | | | 8,286,033 | 9,103,548 | 1.06 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 900,000 | BIZ FINANCE 9.625% 27/04/22 REGS | 931,589 | 900,072 | 0.10 |
| EUR | 650,000 | CHANNEL LINK FRN 30/06/50 A8 | 722,305 | 793,666 | 0.09 |
| GBP | 1,000,000 | KEYSTONE FINA 9.5000% 15/10/19 REGS | 613,924 | 507,961 | 0.06 |
| USD | 486,300 | DTEK FINANCE PIK 31/12/24 | 515,640 | 500,218 | 0.06 |
| USD | 480,000 | BIZ FINANCE 9.75% 22/01/25 REGS | 473,650 | 480,000 | 0.06 |
| | | | 3,257,108 | 3,181,917 | 0.37 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| GBP | 1,479,000 | EI GROUP PLC 6.375% 26/09/31 * | 1,757,830 | 2,133,295 | 0.25 |
| EUR | 1,300,000 | TESCO PLC 5.125% 10/04/47 EMTN | 1,792,125 | 1,884,145 | 0.22 |
| EUR | 1,000,000 | INEOS FIN 4% 01/05/23 REGS | 1,196,751 | 1,182,640 | 0.14 |
| GBP | 750,000 | INVESTEC BANK 9.625% 17/02/22 EMTN | 1,202,118 | 1,174,157 | 0.14 |
| EUR | 1,000,000 | RBS 5.5% 29/11/49 | 698,156 | 1,169,564 | 0.14 |
| GBP | 840,000 | ENTERTAINMENT ONE 6.875% 15/12/22 R | 1,217,797 | 1,151,235 | 0.13 |
| GBP | 1,180,000 | JOHNSTON PRESS BD 8.625% 1/06/19 RE | 1,952,003 | 1,069,403 | 0.12 |
| EUR | 890,000 | ALGECO SCOTSM 6.5000% 15/02/23 REGS | 1,078,304 | 1,053,497 | 0.12 |
| USD | 1,000,000 | FRESNILLO PLC 5.5% 13/11/23 REGS | 1,020,194 | 1,034,280 | 0.12 |
| EUR | 900,000 | TITAN GLOBAL FIN 2.3750% 16/11/24 | 1,091,015 | 988,536 | 0.12 |
| GBP | 660,000 | JERROLD FINCO 6.125% 15/01/24 REGS | 959,813 | 869,766 | 0.10 |
| EUR | 750,000 | INTL PERSONAL FIN 5.75% 07/04/21 EM | 789,854 | 802,772 | 0.09 |
| GBP | 600,000 | PROVIDENT FIN 7.0000% 04/06/23 EMTN | 804,930 | 802,546 | 0.09 |
| USD | 740,000 | LIQUID TELECO 8.5000% 13/07/22 REGS | 780,325 | 736,651 | 0.09 |
| GBP | 500,000 | OLD MUTUAL PLC 8% 03/06/21 EMTN | 975,226 | 722,866 | 0.08 |
| GBP | 600,000 | ANGLIAN WATER 4.0000% 08/03/26 EMTN | 734,166 | 718,420 | 0.08 |
| EUR | 600,000 | MERLIN ENTERT 2.75% 15/03/22 REGS | 646,428 | 718,232 | 0.08 |
| USD | 700,000 | INMARSAT FIN 4.875% 15/05/22 144A | 694,337 | 687,750 | 0.08 |
| EUR | 590,000 | NOMAD FOODS BDCO 3.25% 15/05/24 REG | 632,303 | 680,577 | 0.08 |
| GBP | 510,000 | JEWEL BONDCO 8.5000% 15/04/23 REGS | 725,782 | 664,983 | 0.08 |
| GBP | 500,000 | NEMEAN BONDCO 7.375% 01/02/24 REGS | 674,092 | 619,453 | 0.07 |
| EUR | 500,000 | THOMAS COOK GP 6.25% 15/06/22 REGS | 543,331 | 614,566 | 0.07 |
| USD | 600,000 | KIRS MIDCO 3 8.6250% 15/07/23 144A | 600,000 | 609,000 | 0.07 |
| USD | 625,000 | MARB BONDCO P 6.8750% 19/01/25 REGS | 616,506 | 594,056 | 0.07 |
| GBP | 400,000 | GKN HOLDINGS 5.3750% 19/09/22 EMTN | 619,641 | 575,330 | 0.07 |
| GBP | 500,000 | SHOP DIRECT 7.7500% 15/11/22 REGS | 656,725 | 562,555 | 0.07 |
| GBP | 400,000 | RAC BOND CO 5.0000% 06/11/22 REGS | 518,920 | 494,492 | 0.06 |
| GBP | 400,000 | MATALAN FINAN 6.7500% 31/01/23 REGS | 553,020 | 479,220 | 0.06 |
| GBP | 350,000 | VIRGIN MEDIA SEC 6.25% 28/3/29 REGS | 594,900 | 479,053 | 0.06 |
| USD | 480,000 | TRONOX FINANC 5.7500% 01/10/25 144A | 477,969 | 467,400 | 0.05 |
| USD | 400,000 | ANGLO AMERICAN 4.125% 27/09/22 144A | 337,500 | 402,133 | 0.05 |
| USD | 400,000 | KCA DEUTAG UK 7.25% 15/05/21 144A | 398,000 | 386,000 | 0.04 |
| EUR | 320,000 | INEOS FINANCE 2.1250% 15/11/25 REGS | 376,224 | 353,339 | 0.04 |
| EUR | 300,000 | TA MANUFACTURING 3.625% 15/4/23 REG | 329,580 | 349,844 | 0.04 |
| USD | 310,000 | SOUTHERN GAS CO 6.875% 24/03/26 RE | 322,994 | 334,533 | 0.04 |
| USD | 290,000 | STANDARD BANK 8.125% 02/12/19 GMTN | 306,240 | 304,662 | 0.04 |
| USD | 295,000 | INTL GAME 6.25% 15/02/22 144A | 304,932 | 301,201 | 0.04 |
| USD | 275,000 | KCA DEUTAG UK 9.6250% 01/04/23 144A | 275,000 | 278,781 | 0.03 |
| GBP | 200,000 | JAGUAR LAND ROV 3.875% 01/3/23 REGS | 267,822 | 255,999 | 0.03 |
| USD | 220,000 | TRAVELPORT CO 6.0000% 15/03/26 144A | 220,000 | 221,650 | 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 | 200,000 | ALGECO SCOTSM 8.0000% 15/02/23 144A | 195,994 | 203,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ALGECO FIN 2 10.0000% 15/08/23 144A | 188,016 | 201,500 | 0.02 |
| USD | 200,000 | LYNX/VMED 6.375% 15/04/23 144A | 209,000 | 200,660 | 0.02 |
| USD | 200,000 | NMG FINCO PLC 5.7500% 01/08/22 144A | 200,000 | 198,060 | 0.02 |
| USD | 200,000 | PETRA DIAMONDS 7.25% 01/05/22 144A | 199,986 | 192,750 | 0.02 |
| USD | 200,000 | TULLOW OIL PL 7.0000% 01/03/25 144A | 200,000 | 189,250 | 0.02 |
| USD | 150,000 | FERROGLOBE PLC 9.375% 01/03/22 144A | 150,000 | 155,250 | 0.02 |
| USD | 75,000 | ENSCO PLC 5.75% 01/10/44 | 44,250 | 53,344 | 0.01 |
| USD | 25,000 | ENSCO PLC 7.7500% 01/02/26 | 25,000 | 23,719 | 0.00 |
| | | | <u>31,155,099</u> | <u>30,346,115</u> | <u>3.53</u> |
| | | 合計：イギリス | <u>42,698,240</u> | <u>42,631,580</u> | <u>4.96</u> |
| アメリカ | | | | | |
| バンクローン | | | | | |
| USD | 1,274,349 | CATALYST PAPER FRN 31/12/21 TL | 2,561,389 | 1,146,915 | 0.13 |
| USD | 102,642 | GLOBAL AVIATION FRN 13/01/18 2ND TL (2) | 585,198 | 10 | 0.00 |
| | | | <u>3,146,587</u> | <u>1,146,925</u> | <u>0.13</u> |
| 転換社債 | | | | | |
| USD | 50,000 | CHESAPEAKE CV 5.5000% 15/09/26 144A | 50,000 | 50,713 | 0.01 |
| | | | <u>50,000</u> | <u>50,713</u> | <u>0.01</u> |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 1,300,000 | ILFC E CAP TRUST I FRN 21/12/65 144 | 935,999 | 1,215,499 | 0.14 |
| USD | 825,000 | BANK OF AMERICA CORP FRN 23/10/49 Z | 825,000 | 877,007 | 0.10 |
| USD | 475,000 | JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/01/49 | 475,000 | 516,932 | 0.06 |
| USD | 475,000 | JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/12/49 U | 475,000 | 488,063 | 0.06 |
| USD | 460,000 | JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/10/49 | 494,388 | 474,996 | 0.06 |
| USD | 700,000 | AGFC CAP TRUST FRN 15/01/67 144A | 414,750 | 394,170 | 0.05 |
| USD | 350,000 | SUMMIT MIDSTREAM FRN 15/06/66 A | 350,000 | 343,000 | 0.04 |
| USD | 300,000 | WELLS FARGO & CO FRN 29/12/49 S | 300,000 | 301,374 | 0.04 |
| USD | 300,000 | JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/12/49 Q | 300,000 | 296,421 | 0.03 |
| USD | 275,000 | CITIGROUP INC FRN 29/12/49 HYBRID | 289,125 | 279,813 | 0.03 |
| USD | 275,000 | GOLDMAN SACHS FRN 31/12/49 M | 275,875 | 279,125 | 0.03 |
| USD | 275,000 | CITIGROUP INC FRN 29/05/49 | 275,000 | 271,433 | 0.03 |
| USD | 225,000 | CITIGROUP INC FRN 29/12/49 Q | 225,000 | 232,414 | 0.03 |
| USD | 225,000 | ENERGY TRANSFER FRN 15/02/66 A | 225,000 | 207,281 | 0.02 |
| USD | 200,000 | GOLDMAN SACHS FRN 29/12/49 L | 198,125 | 203,120 | 0.02 |
| USD | 175,000 | BANK OF AMERICA FRN 29/12/49 DD | 175,000 | 184,844 | 0.02 |
| USD | 175,000 | BANK OF AMERICA CORP FRN 29/09/49 X | 175,000 | 182,429 | 0.02 |
| USD | 175,000 | CHARLES SCHWAB FRN 01/06/66 | 175,000 | 167,563 | 0.02 |
| USD | 150,000 | CITIGROUP INC FRN 29/12/49 T | 150,000 | 155,438 | 0.02 |
| USD | 150,000 | PLAINS ALL AMER FRN 15/11/65 B | 150,000 | 141,000 | 0.02 |
| USD | 125,000 | ENERGY TRANSFER FRN 15/02/66 B | 125,000 | 114,063 | 0.01 |
| USD | 75,000 | ALBERTSONS COS FRN 15/01/24 144A | 74,625 | 75,188 | 0.01 |
| USD | 75,000 | GEN MOTORS FIN FRN 30/03/66 A | 75,000 | 71,906 | 0.01 |
| USD | 65,000 | BANK OF AMERICA CORP FRN 29/07/49 K * | 65,469 | 65,276 | 0.01 |
| | | | <u>7,223,356</u> | <u>7,538,355</u> | <u>0.88</u> |
| 普通株式 | | | | | |
| — | 1,488,954 | HOLDCO COMMON STOCK RBR DUMMY | 1,690,646 | 1,042,267 | 0.13 |
| — | 1,272 | HOLDCO MEMBERSHIP INTERESTS | 0 | 1,017,958 | 0.13 |
| — | 19,500 | UCI HOLDINGS INC COMMON STOCK | 309,719 | 438,749 | 0.05 |
| — | 7,677 | BONANZA CREEK ENERGY INC | 224,345 | 294,796 | 0.03 |
| — | 279,010 | IPAYMENT COMMON SHARES | 378,010 | 195,307 | 0.02 |
| — | 8,455 | AVAYA HOLDINGS C | 0 | 168,001 | 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(%) |
|-------------------------|----------------------------|---------------------------------------|------------|-----------|---------|
| — | 8,777 | NINE POINT ENERGY HDG DUMMY | 475,000 | 96,547 | 0.01 |
| — | 31,430 | HERCULES OFFSHORE INC ESC | 1,825,802 | 70,718 | 0.01 |
| — | 1,313 | LINN ENERGY INC NEW NPV | 14,771 | 50,551 | 0.01 |
| — | 7,530 | NII HOLDINGS INC | 180,216 | 29,969 | 0.00 |
| — | 15,777 | BEECHCRAFT BEECH HOLDING/BONY | 0 | 19,721 | 0.00 |
| — | 735 | MIDSTATES PETROLEUM CO INC | 880,364 | 9,996 | 0.00 |
| — | 7,489 | WARREN RESOURCES INC | 0 | 7,489 | 0.00 |
| — | 8,225 | IPAYMENT HLDGS INC | 0 | 5,758 | 0.00 |
| — | 9,727 | BLUESTEM GROUP INC | 178,196 | 5,350 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK J | 0 | 4,589 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK H | 0 | 4,589 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK G | 0 | 4,589 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK C | 0 | 4,589 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK B | 0 | 4,589 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK I | 0 | 4,589 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK E | 0 | 4,589 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK A | 0 | 4,589 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK D | 0 | 4,589 | 0.00 |
| — | 6,580 | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK F | 0 | 4,589 | 0.00 |
| — | 2,846 | AFFINION GROUP HLDGS INC - CL D COM | 766,375 | 726 | 0.00 |
| — | 2,704 | AFFINION GROUP HLDGS INC - CL C COM | 1,059,108 | 690 | 0.00 |
| — | 2,374 | AQUILEX UNIT B DUMMY | 355,555 | 0 | 0.00 |
| — | 1,513 | AQUILEX UNIT A DUMMY | 997,500 | 0 | 0.00 |
| — | 7,000 | GEOKINETICS HOLDINGS | 1,307,093 | 0 | 0.00 |
| — | 22,715 | DIRECTBUY HDGS INC RESTR CO (BONY) | 386,155 | 0 | 0.00 |
| | | | 11,028,855 | 3,500,483 | 0.41 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 685,000 | RIO OIL FINAN 9.2500% 06/07/24 REGS | 505,202 | 499,368 | 0.05 |
| USD | 350,000 | US AIRWAYS 6.75% 2012-2B 03/12/22 | 261,637 | 275,945 | 0.03 |
| USD | 250,000 | RIO OIL FINAN 8.2000% 06/04/28 REGS | 250,000 | 253,250 | 0.03 |
| USD | 275,000 | CONTL AIRLINES 12-2 5.5% 29/04/22 B | 162,321 | 165,509 | 0.02 |
| USD | 200,000 | CIT GROUP INC 3.875% 19/02/19 | 102,250 | 100,100 | 0.01 |
| USD | 50,000 | REYNOLDS GROUP 5.7500% 15/10/20 | 49,956 | 48,637 | 0.01 |
| USD | 362,672 | IHEART COMM INC PIK 14% 01/02/21 | 129,875 | 43,521 | 0.01 |
| | | | 1,461,241 | 1,386,330 | 0.16 |
| ベイ・イン・カインド(PIK)債 | | | | | |
| USD | 770,000 | POLARIS INT PIK 01/12/22 144A | 772,426 | 793,099 | 0.08 |
| USD | 800,000 | VERTIV INT HOLD PIK 12% 15/02/22 14 | 784,000 | 776,000 | 0.09 |
| USD | 1,129,583 | LIBERTY TIRE REC PIK 11% 31/3/21 14 | 1,046,747 | 655,158 | 0.08 |
| USD | 548,469 | SORENSEN COMM PIK 31/10/20 144A | 423,408 | 525,845 | 0.06 |
| USD | 400,000 | INFOR SOFT PIK 7.125% 01/05/21 144A | 400,000 | 400,000 | 0.05 |
| USD | 321,590 | SORENSEN COMM PIK 31/10/21 144A | 242,865 | 328,022 | 0.04 |
| USD | 74,000 | BOXER PARENT CO PIK 9% 15/10/19 144 | 73,815 | 73,908 | 0.01 |
| USD | 277 | ENERGY FUT HDG PIK 11.25% 01/11/17(2) | 112 | 105 | 0.00 |
| | | | 3,743,373 | 3,552,137 | 0.41 |
| ステップアップ/ダウン債 | | | | | |
| USD | 625,000 | MURPHY OIL CORP 3.7% 01/12/22 | 503,204 | 615,568 | 0.08 |
| USD | 375,000 | CRESTWOOD MID 6.25% 01/04/23 WI | 376,875 | 381,563 | 0.04 |
| USD | 350,000 | A SCHULMAN INC STUP 6.875% 01/06/23 | 350,000 | 368,550 | 0.04 |
| USD | 200,000 | SOUTHWESTERN ENERGY 4.95% 23/01/25 | 198,536 | 195,250 | 0.02 |
| USD | 221,000 | ENDO FIN LLC/FIN 5.375% 15/01/23 1 | 211,973 | 176,800 | 0.02 |
| USD | 100,000 | RITE AID CORP 6.875% 15/12/28 | 95,625 | 80,625 | 0.01 |
| | | | 1,736,213 | 1,818,356 | 0.21 |

| 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 | 2,185,000 | SPRINT CAPITAL 8.75% 15/03/32 | 2,602,795 | 2,332,487 | 0.28 |
| EUR | 1,500,000 | INFOR US INC 5.75% 15/05/22 WI | 1,605,626 | 1,763,063 | 0.22 |
| EUR | 1,490,000 | CHEMOURS CO 4.0000% 15/05/26 | 1,749,957 | 1,723,254 | 0.21 |
| USD | 1,745,000 | BWAY HDGS CO 7.25% 15/04/25 144a | 1,746,968 | 1,701,374 | 0.21 |
| EUR | 1,350,000 | SILGAN HOLDINGS 3.2500% 15/03/25 WI | 1,454,389 | 1,586,757 | 0.19 |
| USD | 1,395,000 | HCA INC 7.5% 15/02/22 | 1,607,419 | 1,520,549 | 0.19 |
| USD | 1,545,000 | CCO HDGS LLC 5.75% 15/02/26 144A | 1,614,538 | 1,517,344 | 0.19 |
| EUR | 1,330,000 | EQUINIX INC 2.8750% 01/10/25 | 1,584,751 | 1,458,826 | 0.17 |
| USD | 1,400,000 | LTF MERGER 8.5% 15/06/23 144A | 1,397,385 | 1,455,999 | 0.17 |
| EUR | 1,060,000 | PSPC ESCROW CORP 6% 01/02/23 REGS | 1,115,385 | 1,281,319 | 0.15 |
| USD | 1,335,000 | FRONTIER COMM 10.5% 15/09/22 | 1,286,151 | 1,211,512 | 0.14 |
| USD | 1,125,000 | DYNEGY INC 7.375% 01/11/22 WI | 1,060,178 | 1,174,218 | 0.14 |
| USD | 1,100,000 | PRISO ACQ CORP 9% 15/05/23 144A | 1,099,999 | 1,143,999 | 0.13 |
| EUR | 950,000 | NETFLIX INC 3.6250% 15/05/27 REGS | 1,054,836 | 1,082,100 | 0.13 |
| USD | 1,125,000 | HARLAND CLARKE 9.25% 01/03/21 144A | 1,132,687 | 1,079,999 | 0.13 |
| USD | 1,050,000 | HRG GROUP 7.75% 15/01/22 | 1,044,784 | 1,078,874 | 0.13 |
| USD | 1,075,000 | CHESAPEAKE EN 5.375% 15/06/21 | 1,074,999 | 1,053,499 | 0.12 |
| USD | 1,080,000 | GRIFFON CORP 5.25% 01/03/22 | 1,086,797 | 1,050,731 | 0.12 |
| USD | 1,050,000 | MRT MID PART/FIN 7.25% 15/02/21 | 1,062,384 | 1,036,874 | 0.12 |
| EUR | 900,000 | EQUINIX INC 2.8750% 15/03/24 | 1,099,979 | 1,025,148 | 0.12 |
| USD | 1,025,000 | INFOR US INC 6.5% 15/05/22 WI | 1,035,723 | 1,022,437 | 0.12 |
| USD | 1,025,000 | CITGO PETROLEUM 6.25% 15/08/22 144A | 1,045,632 | 1,020,182 | 0.12 |
| USD | 980,000 | SPRINT CORP 7.875% 15/09/23 | 1,066,207 | 1,019,199 | 0.12 |
| USD | 1,040,000 | LEVEL 3 FINANCING 5.375% 15/01/24 | 1,042,505 | 1,018,679 | 0.12 |
| USD | 1,015,000 | ROSE ROCK MID 5.625% 15/07/22 | 995,402 | 984,549 | 0.11 |
| USD | 1,040,000 | CALIFORNIA RES 8% 15/12/22 144A | 829,973 | 943,799 | 0.11 |
| USD | 975,000 | NAVIENT CORP 5.875% 25/10/24 | 965,980 | 943,312 | 0.11 |
| USD | 975,000 | ARTESYN ESC INC 9.75% 15/10/20 144A | 974,999 | 933,562 | 0.11 |
| EUR | 840,000 | BELDEN INC 3.8750% 15/03/28 REGS | 1,036,937 | 927,397 | 0.11 |
| USD | 950,000 | CNOOC FIN 2015 US 3.5% 05/05/25 | 941,017 | 915,461 | 0.11 |
| EUR | 720,000 | FEDERAL MOGUL 4.875% 15/04/22 REGS | 776,987 | 863,516 | 0.10 |
| USD | 1,400,000 | MURRAY ENERGY 11.25% 15/04/21 144A | 1,065,468 | 850,499 | 0.10 |
| USD | 825,000 | PEABODY SEC FIN 6% 31/03/22 144A | 841,749 | 837,044 | 0.10 |
| EUR | 680,000 | CEMEX FINANCE 4.625% 15/06/24 REGS | 772,955 | 829,881 | 0.10 |
| USD | 895,000 | RADIATE HOLDCO/FIN 6.625% 15/02/25 | 892,505 | 818,924 | 0.10 |
| EUR | 700,000 | AVANTOR INC 4.7500% 01/10/24 REGS | 837,024 | 815,644 | 0.09 |
| USD | 800,000 | LIVE NATION ENT 5.375% 15/06/22 144 | 819,405 | 813,999 | 0.09 |
| USD | 800,000 | PBF LOGIST LP/FIN 6.875% 15/5/23 WI | 807,499 | 806,999 | 0.09 |
| USD | 800,000 | SOUTHERN STAR 5.125% 15/7/22 144A | 804,499 | 797,999 | 0.09 |
| USD | 810,000 | AHERN RENTALS 7.375% 15/5/23 144A | 745,860 | 789,749 | 0.09 |
| USD | 775,000 | EAGLE HDG CO LLC 7.625% 15/05/22 14 | 782,349 | 781,780 | 0.09 |
| USD | 775,000 | SLM CORP 5.5% 15/01/19 MTN | 766,296 | 780,812 | 0.09 |
| EUR | 600,000 | BALL CORP 4.375% 15/12/23 | 663,071 | 778,589 | 0.09 |
| EUR | 610,000 | MPT OPER PARTNERS 4% 19/08/22 | 674,659 | 773,380 | 0.09 |
| USD | 775,000 | SUMMIT MID HDGS 5.5% 15/08/22 | 777,375 | 760,468 | 0.09 |
| USD | 750,000 | CENTURYLINK INC 6.75% 01/12/23 W | 754,395 | 753,749 | 0.09 |
| USD | 725,000 | CENTURY COMM 6.875% 15/05/22 | 725,808 | 741,892 | 0.09 |
| USD | 720,000 | JDA ESC / BOND 7.375% 15/10/24 144 | 736,375 | 741,383 | 0.09 |
| EUR | 660,000 | KRONOS INTL I 3.7500% 15/09/25 REGS | 780,093 | 737,644 | 0.09 |
| USD | 725,000 | GLDEN NUGGET 6.7500% 15/10/24 144A | 721,960 | 725,130 | 0.08 |
| USD | 680,000 | BLUELINE RENTAL 9.25% 15/03/24 144A | 706,498 | 723,451 | 0.08 |
| USD | 750,000 | TRIUMPH GROUP INC 4.875% 01/04/21 | 750,000 | 721,874 | 0.08 |
| USD | 725,000 | EP ENERGY/EVER 9.375% 01/05/20 | 694,060 | 715,937 | 0.08 |
| EUR | 600,000 | ALLIANCE DATA SYST 4.5% 15/03/22 RE | 631,710 | 712,051 | 0.08 |
| USD | 675,000 | BOYD GAMING CORP 6.875% 15/05/23 | 700,161 | 708,749 | 0.08 |
| USD | 695,000 | BRAND ENERGY 8.5000% 15/07/25 144A | 713,725 | 706,293 | 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 | 725,000 | WESTERN DIGITAL 4.7500% 15/02/26 | 726,265 | 705,062 | 0.08 |
| EUR | 580,000 | AXALTA COATING S 4.25% 15/8/24 REGS | 648,092 | 701,469 | 0.08 |
| EUR | 600,000 | IMS HEALTH INC 3.5% 15/10/24 REGS | 673,500 | 698,557 | 0.08 |
| EUR | 600,000 | SUPERIOR IND 6.0000% 15/06/25 REGS | 716,325 | 681,632 | 0.08 |
| USD | 645,000 | MIDCONTINENT COM 6.875% 15/08/23 14 | 655,563 | 677,056 | 0.08 |
| USD | 680,000 | TENET HEALTHCARE 6.75% 15/06/23 | 669,403 | 674,899 | 0.08 |
| USD | 675,000 | USIS MERGER SUB 6.875% 01/05/25 144 | 675,000 | 671,624 | 0.08 |
| USD | 638,000 | ADVANCED MICRO 7% 01/07/24 | 645,439 | 671,495 | 0.08 |
| USD | 994,000 | SANCHEZ ENERY CORP 6.125% 15/1/23 | 856,067 | 670,950 | 0.08 |
| USD | 650,000 | COMMSCOPE TECH FIN 6% 15/06/25 144A | 650,000 | 663,813 | 0.08 |
| USD | 735,000 | TOWNSQUARE MEDIA 6.5% 01/04/23 144A | 715,183 | 661,500 | 0.08 |
| USD | 640,000 | TRANSDIGM INC 6.5% 15/05/25 | 652,370 | 647,200 | 0.08 |
| USD | 675,000 | CALPINE CORP 5.375% 15/01/23 | 666,910 | 642,094 | 0.07 |
| USD | 620,000 | KRATON POLYMERS 7% 15/04/25 144A | 620,000 | 641,700 | 0.07 |
| USD | 625,000 | FELCOR LODGING LP 6% 01/06/25 | 636,813 | 640,625 | 0.07 |
| USD | 640,000 | UNIVERSAL HOSPITAL 7.625% 15/08/20 | 647,291 | 638,400 | 0.07 |
| USD | 600,000 | CITGO HOLDING 10.75% 15/02/20 144A | 602,558 | 638,250 | 0.07 |
| USD | 750,000 | ASP AMC MERGER SUB 8% 15/05/25 144A | 750,000 | 622,500 | 0.07 |
| USD | 625,000 | AMERICAN AIRLINES 4.625% 1/3/20 144 | 625,000 | 621,875 | 0.07 |
| USD | 595,000 | TENET HEALTHCARE 8.125% 1/4/22 | 628,625 | 621,775 | 0.07 |
| USD | 635,000 | CHENIERE ENER 5.2500% 01/10/25 144A | 636,425 | 621,506 | 0.07 |
| USD | 625,000 | GROUP 1 AUTO 5% 01/06/22 | 621,250 | 620,313 | 0.07 |
| USD | 605,000 | REYNOLDS GRP ISS 7% 15/07/24 144A | 619,125 | 617,100 | 0.07 |
| USD | 600,000 | SM ENERGY CO 6.125% 15/11/22 | 570,931 | 615,000 | 0.07 |
| USD | 650,000 | MOHEGAN TRIBAL 7.875% 15/10/24 144A | 654,982 | 614,250 | 0.07 |
| USD | 600,000 | DIAMOND 1 FIN/2 5.875% 15/06/21 144 | 627,882 | 610,320 | 0.07 |
| USD | 500,000 | SOUTHERN COPPER 7.5% 27/07/35 * | 597,929 | 609,520 | 0.07 |
| USD | 600,000 | SELECT MEDICAL 6.375% 01/06/21 | 606,188 | 608,682 | 0.07 |
| USD | 600,000 | JEFFERIES GROUP 7.375% 01/04/20 | 553,500 | 606,000 | 0.07 |
| USD | 600,000 | CINEMARK USA 5.125% 15/12/22 | 600,000 | 605,250 | 0.07 |
| USD | 575,000 | SCOTTS MIRACLE 6% 15/10/23 | 575,000 | 596,563 | 0.07 |
| USD | 620,000 | TEMPO ACQUISITION 6.75% 01/06/25 14 | 623,800 | 595,200 | 0.07 |
| USD | 605,000 | H&E EQUIPMENT 5.6250% 01/09/25 | 615,000 | 594,413 | 0.07 |
| USD | 575,000 | BOYD GAMING CORP 6.375% 1/4/26 WI | 594,538 | 582,188 | 0.07 |
| USD | 600,000 | CCO HLDGS LLC/CAP 5.5% 01/05/26 144 | 615,305 | 582,000 | 0.07 |
| USD | 590,000 | COVANTA HDGS CORP 5.875% 01/03/24 | 587,056 | 581,150 | 0.07 |
| USD | 770,000 | COMMUNITY CHOICE 10.75% 1/05/19 WI | 781,173 | 579,425 | 0.07 |
| USD | 600,000 | KENNEDY WILSON 5.875% 01/04/24 | 599,126 | 579,000 | 0.07 |
| USD | 550,000 | QORVO INC 6.75% 01/12/23 | 594,375 | 578,875 | 0.07 |
| USD | 565,000 | PDC ENERGY INC 6.1250% 15/09/24 | 575,439 | 576,300 | 0.07 |
| USD | 580,000 | PRESTIGE BRANDS 6.375% 01/03/24 144 | 583,481 | 574,200 | 0.07 |
| USD | 690,000 | EP ENER/EVERE 9.3750% 01/05/24 144A | 670,017 | 565,800 | 0.07 |
| USD | 600,000 | COMPASS MINERALS 4.875% 15/7/24 144 | 600,000 | 562,875 | 0.07 |
| USD | 585,000 | ALBERTSONS COS 6.6250% 15/06/24 WI | 591,977 | 554,288 | 0.06 |
| USD | 625,000 | FERRELLGAS LP 6.75% 15/06/23 | 625,000 | 545,313 | 0.06 |
| USD | 550,000 | BUILD MAT CORP 5.375% 15/11/24 144A | 550,000 | 543,125 | 0.06 |
| USD | 525,000 | WARRIOR MET C 8.0000% 01/11/24 144A | 532,969 | 542,063 | 0.06 |
| USD | 575,000 | CHANGE HEALTH/FIN 5.75% 01/03/25 14 | 579,968 | 541,219 | 0.06 |
| USD | 550,000 | MOSS CREEK RE 7.5000% 15/01/26 144A | 550,000 | 540,375 | 0.06 |
| USD | 540,000 | SRC ENERGY 6.2500% 01/12/25 144A | 544,000 | 539,325 | 0.06 |
| USD | 500,000 | TRANSOCEAN INC 9% 15/07/23 144A | 517,000 | 538,125 | 0.06 |
| USD | 550,000 | ALCOA INC 5.95% 01/02/37 | 561,563 | 530,750 | 0.06 |
| USD | 550,000 | MIDAS INT HOLD 7.875% 01/10/22 144A | 543,931 | 530,750 | 0.06 |
| USD | 550,000 | SUBURBAN PROPANE 5.5% 01/06/24 | 550,000 | 530,750 | 0.06 |
| USD | 535,000 | HUB INTL LTD 7.0000% 01/05/26 144A | 535,000 | 529,650 | 0.06 |
| USD | 550,000 | ASSUREDPARTNE 7.0000% 15/08/25 144A | 550,438 | 529,375 | 0.06 |
| USD | 525,000 | GIBRALTAR STEEL 6.25% 01/02/21 | 525,000 | 527,625 | 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(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|---------|---------|
| USD | 550,000 | HILLMAN GROUP INC 6.375% 15/7/22 14 | 545,112 | 526,625 | 0.06 |
| USD | 500,000 | KB HOME 7% 15/12/21 | 500,000 | 525,000 | 0.06 |
| USD | 515,000 | EVERI PAYMENT 7.5000% 15/12/25 144A | 518,031 | 520,150 | 0.06 |
| USD | 514,000 | US CONCRETE INC 6.375% 01/06/24 | 548,090 | 516,570 | 0.06 |
| USD | 500,000 | NRG ENERGY INC 6.25% 15/07/22 | 486,980 | 513,750 | 0.06 |
| USD | 550,000 | GOODYEAR TIRE&RUBBER 5% 31/05/26 | 553,300 | 511,500 | 0.06 |
| USD | 520,000 | ZAYO GRP LLC/CAP 5.75% 15/01/27 | 534,431 | 511,004 | 0.06 |
| USD | 500,000 | MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 | 503,750 | 506,250 | 0.06 |
| USD | 510,000 | WEYERHAEUSER REAL 5.875% 15/6/24 | 507,845 | 506,175 | 0.06 |
| USD | 500,000 | ITALICS MERGER 7.125% 15/07/23 144A | 500,000 | 505,000 | 0.06 |
| USD | 550,000 | CALPINE CORP 5.5% 01/02/24 | 550,000 | 503,250 | 0.06 |
| USD | 520,000 | WEST STREET M 6.3750% 01/09/25 144A | 521,463 | 496,600 | 0.06 |
| USD | 525,000 | REALOGY GROUP 4.875% 01/06/23 144A | 521,162 | 493,500 | 0.06 |
| EUR | 410,000 | WMG ACQUISITION 4.125% 01/11/24 REG | 451,697 | 492,626 | 0.06 |
| USD | 470,000 | VHF PARENT LL 6.7500% 15/06/22 144A | 476,794 | 485,280 | 0.06 |
| USD | 470,000 | SESI LLC 7.7500% 15/09/24 WI | 479,150 | 482,338 | 0.06 |
| USD | 475,000 | DJO FINCO LTD 8.125% 15/06/21 144A | 475,000 | 480,795 | 0.06 |
| USD | 525,000 | COMPRESSCO PART 7.25% 15/08/22 | 520,524 | 480,375 | 0.06 |
| USD | 475,000 | HEALTHSOUTH CORP 5.75% 01/11/24 | 479,664 | 479,750 | 0.06 |
| USD | 505,000 | CLIFFS NATURAL R 5.7500% 01/03/25 | 493,586 | 478,488 | 0.06 |
| USD | 495,000 | EXTRACTION OI 5.6250% 01/02/26 144A | 495,000 | 476,438 | 0.06 |
| USD | 480,000 | CCO HLDGS LLC 5.125% 01/05/23 144A | 493,063 | 473,856 | 0.06 |
| USD | 500,000 | CRC ESCROW IS 5.2500% 15/10/25 144A | 500,344 | 473,125 | 0.06 |
| USD | 475,000 | REYNOLDS GRP ISS 5.125% 15/7/23 144 | 480,250 | 471,438 | 0.05 |
| USD | 450,000 | DONNELLEY FIN 8.25% 15/10/24 WI | 450,000 | 470,250 | 0.05 |
| USD | 450,000 | SPECTRUM BRANDS ESC 6.625% 15/11/22 | 450,000 | 464,625 | 0.05 |
| USD | 450,000 | CHESAPEAKE ENERGY 6.875% 15/11/20 | 419,112 | 463,500 | 0.05 |
| USD | 400,000 | BLUE CUBE SPINCO 10% 15/10/25 | 496,000 | 463,000 | 0.05 |
| USD | 450,000 | GOLDEN NUGGET 8.7500% 01/10/25 144A | 458,466 | 462,245 | 0.05 |
| USD | 485,000 | GRAY TELE INC 5.875% 15/07/26 144A | 486,913 | 461,963 | 0.05 |
| USD | 450,000 | COGENT COM 5.375% 01/03/22 144A | 450,469 | 461,250 | 0.05 |
| EUR | 400,000 | COTY INC 4.0000% 15/04/23 REGS | 489,301 | 459,759 | 0.05 |
| USD | 450,000 | CHESAPEAKE ENRG 8.0000% 15/01/25 WI | 453,262 | 458,438 | 0.05 |
| USD | 428,000 | PRIME SECSRVC 9.25% 15/05/23 144A | 455,509 | 455,820 | 0.05 |
| USD | 450,000 | CPG MERGER SUB 8% 01/10/21 144A | 474,750 | 455,625 | 0.05 |
| USD | 440,000 | CENTURYLINK INC 7.5% 01/04/24 Y | 453,193 | 452,100 | 0.05 |
| USD | 440,000 | MPH ACQUISITION 7.125% 01/06/24 144 | 466,131 | 451,704 | 0.05 |
| USD | 450,000 | LENNAR CORP 4.125% 15/01/22 | 450,000 | 445,500 | 0.05 |
| USD | 400,000 | HCA INC 7.69% 15/06/25 | 451,000 | 442,060 | 0.05 |
| USD | 450,000 | SINCLAIR TELE 5.875% 15/3/26 144 A | 453,553 | 437,625 | 0.05 |
| USD | 450,000 | NEXSTAR ESCROW 5.625% 01/08/24 144A | 450,000 | 435,375 | 0.05 |
| USD | 425,000 | EXELA INTER 10.0000% 15/07/23 144A | 424,766 | 435,094 | 0.05 |
| USD | 455,000 | VENATOR FIN S 5.7500% 15/07/25 144A | 457,000 | 434,525 | 0.05 |
| USD | 405,000 | SCIENTIFIC GAMES INTL 10% 01/12/22 | 404,110 | 431,831 | 0.05 |
| USD | 425,000 | RANGE RESOURCES 5.8750% 01/07/22 WI | 425,000 | 430,313 | 0.05 |
| USD | 425,000 | ARAMARK SERV INC 5.125% 15/01/24 | 440,938 | 425,000 | 0.05 |
| USD | 430,000 | QUICKEN LOANS INC 5.75% 1/5/25 144A | 426,763 | 422,475 | 0.05 |
| USD | 435,000 | GREYSTAR REAL 5.7500% 01/12/25 144A | 439,650 | 421,950 | 0.05 |
| USD | 450,000 | HUGHES SATELLITE 6.625% 01/08/26 | 450,000 | 418,590 | 0.05 |
| USD | 430,000 | CCO HDGS LLC/CAP 5.375% 01/05/25 14 | 441,350 | 416,025 | 0.05 |
| USD | 425,000 | SPEEDWAY MOTORSP 5.125% 01/02/23 | 425,000 | 415,438 | 0.05 |
| USD | 375,000 | ASCENT RESOURCE 10% 01/04/22 144A | 376,547 | 413,438 | 0.05 |
| USD | 425,000 | BWAY HDGS CO 5.5% 15/04/24 144A | 427,900 | 412,250 | 0.05 |
| USD | 435,000 | WILLIAM LYON INC 5.8750% 31/01/25 | 434,781 | 411,619 | 0.05 |
| USD | 400,000 | ASHTREAD CAPITAL 5.625% 1/10/24 144 | 400,000 | 410,000 | 0.05 |
| USD | 415,000 | HCA INC 5.375% 01/02/25 | 424,600 | 409,813 | 0.05 |
| USD | 400,000 | ANIXTER INC 5.125% 01/10/21 | 400,000 | 407,000 | 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 | 395,000 | BIG RVR STL/F 7.2500% 01/09/25 144A | 402,856 | 405,902 | 0.05 |
| USD | 365,000 | GENESYS/GREENDEN 10% 30/11/24 144A | 393,413 | 405,150 | 0.05 |
| USD | 425,000 | NETFLIX INC 4.8750% 15/04/28 144A | 424,043 | 405,097 | 0.05 |
| USD | 400,000 | DRIVETIME AUTO GP 8% 01/06/21 144A | 400,000 | 405,000 | 0.05 |
| USD | 400,000 | CALLON PETROLEUM 6.1250% 01/10/24 | 408,250 | 405,000 | 0.05 |
| USD | 395,000 | XPO LOGISTICS 6.5% 15/06/22 144A | 397,771 | 404,441 | 0.05 |
| USD | 416,000 | GEO GROUP INC 6% 15/04/26 | 416,576 | 403,520 | 0.05 |
| USD | 400,000 | FTS INTL INC 6.2500% 01/05/22 | 371,531 | 403,250 | 0.05 |
| USD | 400,000 | SM ENERGY CO 6.75% 15/09/26 | 401,222 | 402,500 | 0.05 |
| USD | 400,000 | CCO HLDGS LLC/CAP 5.875% 1/4/24 144 | 428,538 | 402,000 | 0.05 |
| USD | 400,000 | HESS INF / FI 5.6250% 15/02/26 144A | 400,000 | 401,000 | 0.05 |
| USD | 375,000 | BEAZER HOMES USA 8.75% 15/03/22 WI | 383,875 | 400,125 | 0.05 |
| USD | 400,000 | RESOLUTE ENERGY CORP 8.5% 1/5/20 | 383,234 | 399,000 | 0.05 |
| USD | 395,000 | NOVELIS CORP 6.25% 15/08/24 144A | 415,609 | 395,000 | 0.05 |
| USD | 400,000 | POST HLDGS 5.5% 01/03/25 144A | 405,093 | 390,000 | 0.05 |
| USD | 400,000 | TTM TECHNOLOG 5.6250% 01/10/25 144A | 401,225 | 390,000 | 0.05 |
| USD | 400,000 | WERNER LP/INC 8.7500% 15/07/25 144A | 400,000 | 388,500 | 0.05 |
| USD | 390,000 | ELDORADO RESORTS 6.0000% 01/04/25 | 408,989 | 388,050 | 0.05 |
| USD | 400,000 | DAE FUNDING 4.5000% 01/08/22 144A | 400,000 | 388,000 | 0.05 |
| USD | 375,000 | NAVISTAR INTL 6.6250% 01/11/25 144A | 380,444 | 385,313 | 0.04 |
| USD | 375,000 | GANNETT CO 6.375% 15/10/23 | 371,573 | 385,313 | 0.04 |
| EUR | 330,000 | BWAY HOLDING 4.7500% 15/04/24 REGS | 381,661 | 383,559 | 0.04 |
| USD | 375,000 | ZAYO GROUP LLC/CAP 6% 01/04/23 | 380,655 | 380,738 | 0.04 |
| USD | 375,000 | COVEY PARK ENERG 7.5% 15/05/25 144A | 380,594 | 379,688 | 0.04 |
| USD | 360,000 | ELDORADO RES INC 7% 01/08/23 WI | 377,940 | 378,000 | 0.04 |
| USD | 450,000 | HEXION US FINANCE 9% 15/11/20 | 354,169 | 377,438 | 0.04 |
| USD | 350,000 | CLOUD CRANE LLC 10.125% 01/08/24 14 | 356,438 | 376,250 | 0.04 |
| USD | 360,000 | ENGLITY CORP 8.8750% 01/09/24 | 376,525 | 376,200 | 0.04 |
| USD | 380,000 | AVANTOR INC 6.0000% 01/10/24 144A | 380,794 | 375,250 | 0.04 |
| USD | 350,000 | NEW ENTERPRISE 10.125% 01/04/22 144 | 350,000 | 371,875 | 0.04 |
| USD | 375,000 | TPC GROUP INC 8.75% 15/12/20 144A | 296,712 | 371,250 | 0.04 |
| USD | 375,000 | SLM CORP 6.125% 25/03/24 MTN | 371,558 | 371,250 | 0.04 |
| USD | 395,000 | LADDER CAP FI 5.2500% 01/10/25 144A | 388,350 | 370,313 | 0.04 |
| USD | 390,000 | SUMMIT MID HDGS 5.75% 15/04/25 | 392,725 | 369,525 | 0.04 |
| USD | 350,000 | GATEWAY CASINO 8.25% 01/03/24 144A | 353,188 | 369,250 | 0.04 |
| USD | 370,000 | UNIT CORP 6.625% 15/05/21 | 372,356 | 369,075 | 0.04 |
| USD | 350,000 | MGM RESORTS INTL 6.75% 01/10/20 | 376,995 | 366,625 | 0.04 |
| USD | 350,000 | JACOBS ENTERT 7.875% 01/02/24 144A | 353,594 | 365,750 | 0.04 |
| USD | 475,000 | CLOUD PEAK ENERGY 6.375% 15/03/24 | 366,563 | 365,750 | 0.04 |
| USD | 375,000 | POST HLDGS 5.75% 01/03/27 144A | 395,625 | 363,750 | 0.04 |
| USD | 375,000 | WILLIAMS CIE 3.7% 15/01/23 | 302,563 | 362,813 | 0.04 |
| USD | 400,000 | FERRELLGAS PART 6.75% 15/01/22 | 404,211 | 362,000 | 0.04 |
| USD | 375,000 | TRIUMPH GROUP 5.25% 01/06/22 | 375,000 | 360,938 | 0.04 |
| USD | 350,000 | TOLL BROS FINANCE 5.625% 15/01/24 | 349,948 | 360,500 | 0.04 |
| USD | 340,000 | DENBURY RESOURCES 9% 15/05/21 144A | 162,761 | 360,400 | 0.04 |
| USD | 380,000 | STATION CASIN 5.0000% 01/10/25 144A | 382,025 | 358,302 | 0.04 |
| USD | 350,000 | ALLY FINANCIAL INC 5.125% 30/09/24 | 343,298 | 356,125 | 0.04 |
| USD | 325,000 | HCA INC 7.58% 15/09/25 MTN | 359,938 | 354,250 | 0.04 |
| USD | 350,000 | ANTERO MIDSTREA 5.3750% 15/09/24 WI | 350,625 | 352,625 | 0.04 |
| EUR | 300,000 | KRATON POLYME 5.2500% 15/05/26 REGS | 354,780 | 350,433 | 0.04 |
| USD | 315,000 | SOLERA LLC/FIN 10.5% 01/03/24 144A | 328,269 | 350,044 | 0.04 |
| USD | 350,000 | LADDER CAP FIN 5.25% 15/03/22 144A | 350,000 | 350,000 | 0.04 |
| USD | 370,000 | EMBARQ CORP 7.995% 01/06/36 | 372,425 | 349,188 | 0.04 |
| USD | 350,000 | TITAN INTL IN 6.5000% 30/11/23 144A | 350,000 | 349,125 | 0.04 |
| USD | 350,000 | ALCOA INC 5.125% 01/10/24 | 365,750 | 347,652 | 0.04 |
| USD | 340,000 | CVR REF LLC/COFF 6.5% 01/11/22 | 323,658 | 346,800 | 0.04 |
| USD | 360,000 | PISCES MIDCO 8.0000% 15/04/26 144A | 360,000 | 346,248 | 0.04 |

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 | 330,000 | MATADOR RES 6.875% 15/04/23 | 344,282 | 345,675 | 0.04 |
| USD | 340,000 | CONTINENTAL RES 4.5% 15/04/23 | 314,471 | 345,202 | 0.04 |
| USD | 375,000 | ACRISURE LLC 7.0000% 15/11/25 144A | 375,000 | 343,125 | 0.04 |
| USD | 325,000 | EXTERRAN SOL/FI 8.1250% 01/05/25 WI | 325,000 | 342,875 | 0.04 |
| USD | 324,000 | HERC RENTALS INC 7.5% 01/06/22 144A | 333,872 | 342,630 | 0.04 |
| USD | 325,000 | MATCH GRP 6.375% 01/06/24 | 325,000 | 342,063 | 0.04 |
| USD | 325,000 | MPT OPER PARTNER 6.375% 01/03/24 | 325,000 | 340,438 | 0.04 |
| USD | 375,000 | HEXION 2 US FIN 13.75% 1/2/22 144A | 369,946 | 340,313 | 0.04 |
| USD | 360,000 | CSC HOLDINGS 5.25% 01/06/24 | 345,850 | 340,200 | 0.04 |
| USD | 300,000 | WPX ENERGY INC 8.25% 01/08/23 | 343,406 | 339,750 | 0.04 |
| USD | 350,000 | SIRIUS XM RAD 3.8750% 01/08/22 144A | 348,750 | 336,875 | 0.04 |
| USD | 350,000 | CHOBANI LLC/FIN 7.5% 15/04/25 144A | 350,000 | 336,000 | 0.04 |
| USD | 330,000 | ASCEND LEARNING LLC 6.875% 01/08/25 | 332,100 | 332,888 | 0.04 |
| USD | 335,000 | SINCLAIR TELE 5.625% 01/08/24 144A | 343,375 | 332,488 | 0.04 |
| USD | 325,000 | WR GRACE & CO 5.125% 01/10/21 144A | 325,000 | 332,313 | 0.04 |
| USD | 325,000 | WHITING PETROLEUM 5.75% 15/03/21 | 296,344 | 332,140 | 0.04 |
| USD | 325,000 | WILDHORSE RESO 6.8750% 01/02/25 | 321,559 | 331,094 | 0.04 |
| USD | 310,000 | ENERGY TRANSFER EQ 7.5% 15/10/20 | 339,539 | 330,538 | 0.04 |
| USD | 325,000 | HECLA MINING CO 6.875% 01/05/21 | 311,000 | 328,442 | 0.04 |
| USD | 350,000 | POST HOLDINGS 5.6250% 15/01/28 144A | 350,000 | 328,125 | 0.04 |
| USD | 400,000 | ENDO FIN LLC/FINCO 6% 15/07/23 144A | 351,750 | 328,000 | 0.04 |
| USD | 400,000 | VERITAS US 10.5% 01/02/24 144A | 432,500 | 327,000 | 0.04 |
| USD | 320,000 | ALLY FINANCIAL INC 5.75% 20/11/25 | 330,554 | 325,600 | 0.04 |
| USD | 350,000 | NWH ESCROW CORP 7.5% 01/08/21 144a | 329,000 | 324,625 | 0.04 |
| USD | 320,000 | ANTERO RESOURCE 5.625% 1/6/23 | 326,084 | 324,000 | 0.04 |
| USD | 310,000 | FBM FINANCE INC 8.25% 15/08/21 144A | 327,500 | 323,175 | 0.04 |
| USD | 330,000 | TAYLOR MORRISON 5.625% 01/03/24 144 | 330,000 | 322,780 | 0.04 |
| USD | 325,000 | RHP HOTEL /RHP FIN 5% 15/04/23 | 325,000 | 322,563 | 0.04 |
| USD | 350,000 | BEACON ESCROW 4.8750% 01/11/25 144A | 343,638 | 321,790 | 0.04 |
| USD | 345,000 | MULTI-COLOR C 4.8750% 01/11/25 144A | 345,000 | 321,281 | 0.04 |
| USD | 300,000 | ALLIANCE RES OP/FIN 7.5% 1/05/25 14 | 300,000 | 319,500 | 0.04 |
| USD | 305,000 | ENVIVA PRTRNS 8.5000% 01/11/21 WI | 322,963 | 317,200 | 0.04 |
| USD | 306,000 | USA PART/USA 6.8750% 01/04/26 144A | 308,419 | 316,710 | 0.04 |
| USD | 325,000 | RANGE RESOURCES 5.0000% 15/03/23 WI | 321,547 | 315,250 | 0.04 |
| USD | 315,000 | CRESTWOOD MID PA 5.7500% 01/04/25 | 315,000 | 315,000 | 0.04 |
| USD | 325,000 | SBA COMMUNICA 4.0000% 01/10/22 144A | 325,000 | 312,406 | 0.04 |
| USD | 300,000 | HCA INC 6.50% 15/02/20 | 317,759 | 311,940 | 0.04 |
| USD | 315,000 | US STEEL CORP 6.2500% 15/03/26 | 315,000 | 311,850 | 0.04 |
| USD | 325,000 | DAE FUNDING 5.0000% 01/08/24 144A | 325,000 | 311,188 | 0.04 |
| USD | 300,000 | BEACON ROOF 6.375% 01/10/23 | 300,000 | 310,500 | 0.04 |
| USD | 325,000 | ARAMARK SERV 5.0000% 01/02/28 144A | 325,969 | 310,375 | 0.04 |
| USD | 315,000 | NAVIENT CORP 5.5% 25/01/23 | 312,363 | 309,881 | 0.04 |
| USD | 360,000 | TENN MERGER 6.375% 01/02/25 144A | 338,044 | 308,700 | 0.04 |
| USD | 315,000 | PLATFORM SPEC 5.8750% 01/12/25 144A | 311,965 | 308,306 | 0.04 |
| USD | 300,000 | XPO LOGISTICS 6.125% 01/09/23 144A | 308,656 | 307,875 | 0.04 |
| USD | 300,000 | MICRON TECHNO 5.5% 01/02/25 | 314,906 | 307,839 | 0.04 |
| USD | 312,000 | MEREDITH CORP 6.8750% 01/02/26 144A | 315,675 | 307,710 | 0.04 |
| USD | 300,000 | ADT CORP 5.2500% 15/03/20 | 316,875 | 304,500 | 0.04 |
| USD | 300,000 | ARUBA INV 8.75% 15/02/23 144A | 300,000 | 302,813 | 0.04 |
| USD | 300,000 | FORUM ENERGY TECH 6.25% 01/10/21 | 303,000 | 299,250 | 0.03 |
| USD | 325,000 | SINCLAIR TELE 5.125% 15/02/27 144A | 325,000 | 299,000 | 0.03 |
| USD | 295,000 | MERCER INTL INC 6.5000% 01/02/24 | 297,188 | 298,688 | 0.03 |
| USD | 310,000 | GULFPORT ENERGY 6.0000% 15/10/24 | 311,899 | 298,375 | 0.03 |
| USD | 350,000 | SANCHEZ ENERY CORP 7.75% 15/6/21 | 340,750 | 298,375 | 0.03 |
| USD | 295,000 | COMMSCOPE 5.5% 15/06/24 144A | 296,475 | 297,213 | 0.03 |
| USD | 450,000 | WINDSTREAM HDGS 6.75% 01/04/28 | 432,000 | 297,000 | 0.03 |
| USD | 300,000 | CALPINE CORP 5.875% 15/01/24 144A | 300,000 | 297,000 | 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 | 275,000 | STANDARDAERO AVIAT 10% 15/07/23 144 | 271,288 | 296,656 | 0.03 |
| USD | 300,000 | LAREDO PETROLEUM 5.625% 15/01/22 | 263,250 | 295,875 | 0.03 |
| USD | 275,000 | QORVO INC 7% 01/12/25 | 283,063 | 295,625 | 0.03 |
| USD | 300,000 | HEXION INC 10.375% 01/02/22 144A | 300,033 | 294,000 | 0.03 |
| USD | 300,000 | NFP CORP 6.8750% 15/07/25 144A | 300,000 | 294,000 | 0.03 |
| USD | 290,000 | LIONS GATE CA 5.8750% 01/11/24 144A | 291,879 | 293,535 | 0.03 |
| USD | 285,000 | MULTI-COLOR 6.125% 01/12/22 144A | 286,500 | 292,125 | 0.03 |
| USD | 320,000 | OLYMPUS MERGE 8.5000% 15/10/25 144A | 314,378 | 292,000 | 0.03 |
| USD | 280,000 | CHENIERE CORP 5.875% 31/03/25 WI | 294,688 | 291,900 | 0.03 |
| USD | 275,000 | CRESCENT COMM 8.875% 15/10/21 144A | 275,476 | 291,156 | 0.03 |
| USD | 425,000 | EP ENERGY/EVER 6.375% 15/06/23 | 328,158 | 291,125 | 0.03 |
| USD | 300,000 | SUNOCO LP/FIN 4.8750% 15/01/23 144A | 300,000 | 288,471 | 0.03 |
| USD | 325,000 | ALBERTSONS COS 5.7500% 15/03/25 WI | 325,000 | 287,625 | 0.03 |
| USD | 300,000 | GRAY TELE INC 5.125% 15/10/24 144A | 300,938 | 287,160 | 0.03 |
| USD | 275,000 | FIRST DATA CORP 7% 01/12/23 144A | 294,764 | 286,660 | 0.03 |
| USD | 320,000 | SPARC EM PANAMA 0% 05/12/22 REGS | 287,520 | 286,240 | 0.03 |
| USD | 300,000 | NOVELIS CORP 5.875% 30/09/26 144A | 299,250 | 286,125 | 0.03 |
| USD | 305,000 | GENESIS ENERGY 6.2500% 15/05/26 | 305,000 | 285,556 | 0.03 |
| USD | 300,000 | CONSTELLATION 8.5000% 15/09/25 144A | 300,000 | 285,375 | 0.03 |
| USD | 275,000 | DANA HOLDING CO 6% 15/09/23 | 287,885 | 284,969 | 0.03 |
| USD | 275,000 | DIAMOND OFFSHORE 7.8750% 15/08/25 | 278,283 | 284,625 | 0.03 |
| USD | 275,000 | AV HOMES INC 6.6250% 15/05/22 WI | 275,000 | 283,938 | 0.03 |
| USD | 275,000 | TENET HEALTHCARE 6% 01/10/20 | 294,594 | 283,594 | 0.03 |
| USD | 350,000 | CSVC ACQUISIT 7.7500% 15/06/25 144A | 350,000 | 283,500 | 0.03 |
| USD | 275,000 | MGIC INVESTMENT CORP 5.75% 15/08/23 | 275,000 | 280,500 | 0.03 |
| USD | 300,000 | T-MOBILE USA INC 4.5000% 01/02/26 | 300,000 | 280,125 | 0.03 |
| USD | 300,000 | HUNT COS INC 6.2500% 15/02/26 144A | 299,906 | 279,750 | 0.03 |
| USD | 300,000 | ASHTHEAD CAPIT 4.3750% 15/08/27 144A | 288,000 | 279,000 | 0.03 |
| USD | 285,000 | ORTHO-CLINICAL 6.625% 15/05/22 144A | 282,578 | 278,588 | 0.03 |
| USD | 275,000 | J2 CLOUD LLC/ 6.0000% 15/07/25 144A | 275,375 | 278,438 | 0.03 |
| USD | 275,000 | ICAHN ENTER 6% 01/08/20 | 272,828 | 278,438 | 0.03 |
| USD | 300,000 | T-MOBILE USA INC 4.7500% 01/02/28 | 300,000 | 277,875 | 0.03 |
| USD | 275,000 | CCO HDGS LLC/CAP 5.75% 01/09/23 | 288,000 | 277,063 | 0.03 |
| USD | 275,000 | WEYERHAEUSER REAL 4.375% 15/6/19 | 271,959 | 276,375 | 0.03 |
| USD | 261,000 | INVENTIV HEALTH 7.5% 01/10/24 144A | 261,000 | 274,703 | 0.03 |
| USD | 275,000 | NGPL PIPECO L 4.3750% 15/08/22 144A | 275,531 | 272,938 | 0.03 |
| USD | 258,000 | CF INDUSTRIES INC 7.125% 01/05/20 | 283,800 | 272,513 | 0.03 |
| USD | 275,000 | CCO HDGS LLC/CAP 5.125% 15/02/23 | 285,031 | 272,170 | 0.03 |
| USD | 275,000 | DAE FUNDING 4.0000% 01/08/20 144A | 275,000 | 271,906 | 0.03 |
| USD | 275,000 | COOPER STANDARD 5.625% 15/11/26 | 275,000 | 271,563 | 0.03 |
| USD | 295,000 | FIRST QUAL FI 5.0000% 01/07/25 144A | 293,200 | 269,925 | 0.03 |
| USD | 275,000 | CORTES NP ACQ 9.25% 15/10/24 144A | 275,000 | 269,500 | 0.03 |
| USD | 265,000 | NEW ENTERPRIS 6.2500% 15/03/26 144A | 265,488 | 267,650 | 0.03 |
| USD | 300,000 | TALEN ENERGY 10.5000% 15/01/26 144A | 296,125 | 267,000 | 0.03 |
| USD | 275,000 | AMERIGAS PART/FIN 5.5% 20/05/25 | 275,000 | 266,406 | 0.03 |
| USD | 275,000 | VECTOR GROUP LTD 6.125% 01/02/25 14 | 275,000 | 265,719 | 0.03 |
| USD | 275,000 | INDIGO NAT RE 6.8750% 15/02/26 144A | 275,000 | 265,375 | 0.03 |
| USD | 275,000 | SOUTHWESTERN ENERGY 4.1% 15/03/22 | 242,250 | 263,656 | 0.03 |
| USD | 255,000 | CVR PART / NITROGE 9.25% 15/06/23 1 | 261,624 | 262,331 | 0.03 |
| USD | 300,000 | FREEPORT-MCMORAN 5.45% 15/03/43 | 257,972 | 261,750 | 0.03 |
| USD | 275,000 | ASHTON WOODS 6.7500% 01/08/25 144A | 275,750 | 261,250 | 0.03 |
| USD | 255,000 | ENPRO INDUSTRIES 5.875% 15/09/22 | 257,550 | 260,100 | 0.03 |
| USD | 275,000 | CENTURY COMMUNIT 5.8750% 15/07/25 | 275,000 | 259,215 | 0.03 |
| USD | 275,000 | SONIC AUTOMOTIVE 6.1250% 15/03/27 | 275,000 | 259,188 | 0.03 |
| USD | 250,000 | CENTRAL GARDEN PET 6.125% 15/11/23 | 250,000 | 258,750 | 0.03 |
| EUR | 235,000 | SCIENTIFIC GA 5.5000% 15/02/26 REGS | 291,976 | 257,435 | 0.03 |
| USD | 225,000 | ROCKIES EXPRESS 6.875% 15/04/40 144 | 264,281 | 256,500 | 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 | 250,000 | CLEAR CHAN WLD 6.5% 15/11/22 wi | 259,688 | 255,000 | 0.03 |
| USD | 250,000 | CBS OUT AMER 5.25% 15/02/22 WI | 250,000 | 253,750 | 0.03 |
| USD | 250,000 | NABORS INDUS 5% 15/09/20 | 249,219 | 252,500 | 0.03 |
| USD | 250,000 | HOLLY ENERGY PART 6% 01/08/24 144A | 251,625 | 252,500 | 0.03 |
| USD | 245,000 | WHITING PETRO 6.6250% 15/01/26 144A | 245,906 | 252,350 | 0.03 |
| USD | 250,000 | LEVEL 3 FIN INC 6.125% 15/1/21 | 254,750 | 251,563 | 0.03 |
| USD | 255,000 | AMC NETWORKS INC 5% 01/04/24 | 257,997 | 251,175 | 0.03 |
| USD | 250,000 | HCA INC 3.75% 15/03/19 | 254,531 | 250,938 | 0.03 |
| USD | 250,000 | CALLON PETROL 6.3750% 01/07/26 144A | 250,000 | 250,625 | 0.03 |
| USD | 250,000 | SHEA HOMES LP 6.125% 01/04/25 144A | 250,000 | 250,625 | 0.03 |
| USD | 250,000 | SHEA HOMES LP 5.875% 01/04/23 144A | 250,000 | 250,313 | 0.03 |
| USD | 250,000 | INTREPID AVIATION 6.875% 15/2/19 14 | 229,375 | 249,063 | 0.03 |
| USD | 250,000 | KFC HOLD PIZZA 5% 01/06/24 144A | 250,000 | 246,875 | 0.03 |
| USD | 245,000 | CYRUSONE LP/CYR 5.0000% 15/03/24 WI | 247,625 | 245,000 | 0.03 |
| USD | 240,000 | SUMMIT MAT LLC 6.125% 15/07/23 | 248,088 | 243,600 | 0.03 |
| USD | 245,000 | NVA HOLDINGS 6.8750% 01/04/26 144A | 245,000 | 243,469 | 0.03 |
| USD | 250,000 | ENDEAVOR ENER 5.5000% 30/01/26 144A | 251,688 | 241,875 | 0.03 |
| USD | 245,000 | ZACHRY HDGS INC 7.5% 01/02/20 144A | 250,405 | 241,019 | 0.03 |
| USD | 255,000 | WRANGLER BUYE 6.0000% 01/10/25 144A | 253,800 | 240,975 | 0.03 |
| USD | 245,000 | JAGGED PEAK E 5.8750% 01/05/26 144A | 245,000 | 240,100 | 0.03 |
| USD | 300,000 | WEATHFORD BERMUDA 7% 15/03/38 | 284,438 | 239,250 | 0.03 |
| USD | 250,000 | RADIAN GROUP INC 4.5000% 01/10/24 | 250,000 | 238,750 | 0.03 |
| USD | 250,000 | IRB HOLDING C 6.7500% 15/02/26 144A | 250,739 | 238,750 | 0.03 |
| USD | 250,000 | TENET HEALTHC 4.6250% 15/07/24 144A | 250,000 | 237,188 | 0.03 |
| USD | 240,000 | WILLIAM LYON 6.0000% 01/09/23 144A | 240,000 | 236,930 | 0.03 |
| USD | 250,000 | EW SCRIPPS CO 5.125% 15/05/25 144A | 251,938 | 234,375 | 0.03 |
| USD | 225,000 | PARSLEY ENERGY 6.25% 01/06/24 144A | 227,500 | 233,438 | 0.03 |
| USD | 235,000 | TARGA RESOURCES 5.125% 1/02/25 | 238,006 | 232,063 | 0.03 |
| USD | 225,000 | SPRINGLEAF FINANCE 6% 01/06/20 WI | 230,625 | 230,906 | 0.03 |
| USD | 225,000 | ABC SUPPLY 5.75% 15/12/23 144A | 225,000 | 230,625 | 0.03 |
| USD | 225,000 | NEXSTAR BROAD 6.125% 15/02/22 144A | 225,000 | 230,063 | 0.03 |
| USD | 225,000 | TALLGRASS NRG PRT 5.5% 15/9/24 144A | 225,000 | 229,329 | 0.03 |
| USD | 225,000 | CDK GLOBAL INC 5.8750% 15/06/26 | 226,125 | 229,219 | 0.03 |
| USD | 260,000 | DISH DBS CORP 7.75% 01/07/26 | 259,956 | 227,825 | 0.03 |
| USD | 220,000 | UNIVAR INC 6.75% 15/07/23 144A | 231,000 | 227,425 | 0.03 |
| USD | 225,000 | NATHAN'S FAMO 6.6250% 01/11/25 144A | 230,000 | 227,250 | 0.03 |
| USD | 225,000 | MEDIACOM LLC/CORP 5.5% 15/04/21 | 225,000 | 227,250 | 0.03 |
| USD | 250,000 | COMM SALES&LEAS 7.125% 15/12/24 144 | 251,813 | 226,875 | 0.03 |
| USD | 225,000 | INCEPTION MRGR 8.625% 15/11/24 144A | 227,753 | 226,125 | 0.03 |
| USD | 230,000 | GENESIS ENERGY LP/GENESI 6% 15/5/23 | 233,450 | 225,400 | 0.03 |
| USD | 200,000 | BRASKEM FINANCE 7.125% 22/07/41 REG | 231,940 | 225,250 | 0.03 |
| USD | 225,000 | PATTERN ENERGY GP 5.875% 01/02/24 1 | 225,000 | 225,000 | 0.03 |
| USD | 245,000 | ONEX YORK ACQ 8.5% 01/10/22 144A | 236,731 | 224,814 | 0.03 |
| USD | 230,000 | COMMERCIAL ME 5.7500% 15/04/26 144A | 230,000 | 223,675 | 0.03 |
| USD | 225,000 | NATIONSTAR MORT 6.5% 01/06/22 | 225,844 | 223,313 | 0.03 |
| USD | 200,000 | NEPTUNE FINCO 10.125% 15/01/23 144A | 231,624 | 221,000 | 0.03 |
| USD | 225,000 | SEMGROUP CORP 7.2500% 15/03/26 | 221,519 | 220,500 | 0.03 |
| USD | 225,000 | AMERICAN MIDSTREAM 8.5% 15/12/21 14 | 226,781 | 220,500 | 0.03 |
| USD | 225,000 | BMC EAST LLC 5.5% 01/10/24 144A | 225,000 | 219,375 | 0.03 |
| USD | 210,000 | AES CORP 6% 15/05/26 | 215,333 | 217,350 | 0.03 |
| USD | 225,000 | TERRAFORM POW 4.2500% 31/01/23 144A | 225,000 | 217,125 | 0.03 |
| USD | 225,000 | AMC ENTMNT HOLDI 5.8750% 15/11/26 | 235,688 | 216,563 | 0.03 |
| USD | 200,000 | JACK OHIO FIN 10.25% 15/11/22 144 | 200,000 | 216,500 | 0.03 |
| USD | 210,000 | MGM RESORTS INTL 6% 15/03/23 | 213,400 | 216,300 | 0.03 |
| USD | 225,000 | WASTE PRO USA 5.5000% 15/02/26 144A | 225,400 | 216,281 | 0.03 |
| USD | 230,000 | DAVITA HEALTHCARE 5% 01/05/25 | 228,403 | 215,717 | 0.03 |
| USD | 225,000 | NRG YIELD OPERAT 5.0000% 15/09/26 | 225,000 | 214,313 | 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 | 225,000 | AMERIGAS PART/FIN 5.75% 20/05/27 | 224,625 | 213,750 | 0.02 |
| USD | 225,000 | WEEKLEY HM LL 6.6250% 15/08/25 144A | 219,895 | 213,188 | 0.02 |
| USD | 200,000 | BCD ACQUISIT INC 9.625% 15/09/23 14 | 200,000 | 213,000 | 0.02 |
| USD | 225,000 | FREEPOR-T-MCMORAN 3.875% 15/03/23 | 218,813 | 212,906 | 0.02 |
| USD | 256,000 | CHS/COMMUNITY 8.1250% 30/06/24 144A | 239,184 | 210,880 | 0.02 |
| USD | 200,000 | MGM RESORTS INTL 6.625% 15/12/21 | 204,500 | 210,750 | 0.02 |
| USD | 215,000 | AMC ENTERTAINMT 5.75% 15/06/25 | 222,281 | 209,625 | 0.02 |
| USD | 205,000 | CARRIZO OIL&GAS INC 6.25% 15/04/23 | 196,986 | 207,563 | 0.02 |
| USD | 200,000 | T-MOBILE USA INC 6.375% 01/03/25 | 215,220 | 207,500 | 0.02 |
| USD | 205,000 | FIRST DATA CORP 5.375% 15/8/23 144A | 212,174 | 207,050 | 0.02 |
| USD | 225,000 | TRI POINTE GROUP 5.2500% 01/06/27 | 225,000 | 206,438 | 0.02 |
| USD | 200,000 | SABRA HEALTH 5.5% 01/02/21 | 200,000 | 204,255 | 0.02 |
| USD | 205,000 | TAYLOR MORRISON 5.875% 15/4/23 144A | 215,763 | 203,975 | 0.02 |
| USD | 225,000 | CARDTRONICS INC 5.5% 01/05/25 144A | 225,000 | 203,625 | 0.02 |
| USD | 200,000 | CCM MERGER INC 6% 15/03/22 144A | 200,000 | 203,560 | 0.02 |
| USD | 200,000 | CEMEX FINANCE 6% 01/04/24 144A | 200,000 | 202,500 | 0.02 |
| USD | 200,000 | AVANTOR INC 9.0000% 01/10/25 144A | 201,548 | 202,500 | 0.02 |
| USD | 200,000 | BLUE RACER MID 6.125% 15/11/22 144A | 204,500 | 202,000 | 0.02 |
| USD | 220,000 | CALPINE CORP 5.75% 15/01/25 | 213,042 | 201,850 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ENVISION HEALTH 5.125% 01/07/22 144 | 200,000 | 201,750 | 0.02 |
| USD | 200,000 | US STEEL CORP 6.8750% 15/08/25 | 200,000 | 201,370 | 0.02 |
| USD | 200,000 | TRANSDIGM INC 6% 15/07/22 | 200,750 | 201,060 | 0.02 |
| USD | 200,000 | HCA INC 5% 15/03/24 | 210,000 | 200,250 | 0.02 |
| USD | 200,000 | DELEK LOGISTICS 6.7500% 15/05/25 WI | 198,490 | 200,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ALTICE US FIN I 5.375% 15/7/23 144A | 205,000 | 199,000 | 0.02 |
| USD | 225,000 | CF INDUSTRIES INC 5.375% 15/03/44 | 208,741 | 198,563 | 0.02 |
| USD | 200,000 | SPX FLOW INC 5.625% 15/08/24 144A | 200,000 | 198,500 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ENERGY TRANSFE 5.8000% 15/06/38 20Y | 199,294 | 198,428 | 0.02 |
| USD | 200,000 | SPX FLOW INC 5.875% 15/08/26 144A | 200,000 | 198,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | TRUMPHE GROUP 7.7500% 15/08/25 | 200,000 | 198,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | HARLAND CLARKE 6.875% 01/03/20 144A | 200,000 | 197,500 | 0.02 |
| USD | 200,000 | BOYD GAMING C 6.0000% 15/08/26 144A | 200,000 | 197,500 | 0.02 |
| USD | 200,000 | JEFFERIES FIN LL 7.2500% 15/08/24 | 200,000 | 196,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | NAVIENT CORP 6.7500% 15/06/26 | 200,000 | 196,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | IRON MOUNTAIN INC 5.75% 15/08/24 | 202,000 | 196,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | MSCI INC 4.75% 01/08/26 144A | 200,000 | 193,500 | 0.02 |
| USD | 200,000 | CROWNROCK LP/ 5.6250% 15/10/25 144A | 200,056 | 193,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | GROUP 1 AUTO 5.25% 15/12/23 144A | 200,000 | 192,500 | 0.02 |
| USD | 200,000 | RAIZEN FUELS FIN 5.3% 20/01/27 REGS | 208,880 | 192,500 | 0.02 |
| USD | 190,000 | RADIAN GROUP INC 5.25% 15/06/20 | 190,000 | 191,900 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ENTEGRIS INC 4.6250% 10/02/26 144A | 200,000 | 190,500 | 0.02 |
| USD | 160,000 | ALLY FINANCIAL 8% 01/11/31 | 193,154 | 190,400 | 0.02 |
| USD | 185,000 | SPRINT CORP 7.625% 15/02/25 | 201,544 | 189,625 | 0.02 |
| USD | 200,000 | WYNN LAS VEGAS 5.25% 15/05/27 144A | 200,938 | 188,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | CALPINE CORP 5.25% 01/06/26 144A | 200,000 | 187,500 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ASHTHEAD CAPIT 4.1250% 15/08/25 144A | 196,500 | 187,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | VIASAT INC 5.6250% 15/09/25 144A | 200,113 | 187,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | HALCON RESOURCE 6.7500% 15/02/25 WI | 206,000 | 186,500 | 0.02 |
| USD | 191,000 | CLEVELAND-CLI 4.8750% 15/01/24 144A | 189,753 | 184,315 | 0.02 |
| USD | 180,000 | ICAHN ENTER/FIN 6.2500% 01/02/22 WI | 183,699 | 183,600 | 0.02 |
| USD | 190,000 | MERCER INTL I 5.5000% 15/01/26 144A | 189,044 | 182,875 | 0.02 |
| USD | 181,000 | SABRE INC 5.375% 15/04/23 144A | 184,034 | 182,810 | 0.02 |
| USD | 200,000 | NATIONAL CINEMED 5.75% 15/08/26 WI | 200,000 | 182,500 | 0.02 |
| USD | 175,000 | WILLIAMS SCOT 7.8750% 15/12/22 144A | 175,000 | 181,125 | 0.02 |
| USD | 175,000 | T-MOBILE USA INC 6% 15/04/24 | 187,359 | 181,125 | 0.02 |
| USD | 175,000 | CLOUD PEAK ENERGY 12% 01/11/21 | 177,188 | 180,688 | 0.02 |
| USD | 175,000 | NETFLIX INC 5.875% 15/02/25 | 180,688 | 179,513 | 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 | 175,000 | NAVIENT CORP 6.5% 15/06/22 | 175,660 | 179,156 | 0.02 |
| USD | 175,000 | DOWNSTREAM D 10.5000% 15/02/23 144A | 175,094 | 178,500 | 0.02 |
| USD | 173,000 | K HOVNANIAN 13.5000% 01/02/26 144A | 212,243 | 177,325 | 0.02 |
| USD | 175,000 | GRAHAM HOLDIN 5.7500% 01/06/26 144A | 175,000 | 176,750 | 0.02 |
| USD | 175,000 | UNITED RENTALS 5.875% 15/09/26 | 182,156 | 176,750 | 0.02 |
| USD | 200,000 | ENDO 5.75% 15/01/22 144A | 190,500 | 176,500 | 0.02 |
| USD | 175,000 | BALL CORP 4.375% 15/12/20 | 181,781 | 176,313 | 0.02 |
| USD | 175,000 | CONSOL ENERGY 5.875% 15/04/22 | 180,469 | 175,893 | 0.02 |
| USD | 180,000 | GULFPORT ENERGY 6.3750% 15/05/25 | 181,375 | 174,600 | 0.02 |
| USD | 175,000 | MURPHY OIL CORP 5.7500% 15/08/25 | 175,000 | 174,510 | 0.02 |
| USD | 175,000 | GARTNER INC 5.125% 01/04/25 144A | 175,000 | 173,688 | 0.02 |
| USD | 175,000 | NRG ENERGY IN 5.7500% 15/01/28 144A | 175,000 | 172,375 | 0.02 |
| USD | 175,000 | ISTAR INC 4.6250% 15/09/20 | 175,000 | 171,938 | 0.02 |
| USD | 170,000 | MUELLER WATER 5.5000% 15/06/26 144A | 170,000 | 171,275 | 0.02 |
| USD | 175,000 | COMMERCIAL METALS 4.875% 15/05/23 | 175,000 | 171,115 | 0.02 |
| USD | 175,000 | CENTENNIAL RE 5.3750% 15/01/26 144A | 175,000 | 170,625 | 0.02 |
| USD | 175,000 | WEEKLEY HOMES LLC 6% 01/02/23 | 156,188 | 169,750 | 0.02 |
| USD | 170,000 | TRANSDIGM INC 6.375% 15/06/26 WI | 170,000 | 168,725 | 0.02 |
| USD | 175,000 | NEXTERA ENERG 4.2500% 15/09/24 144A | 175,000 | 168,438 | 0.02 |
| USD | 167,000 | ASHTON WOODS USA 6.875% 15/2/21 144 | 166,793 | 167,835 | 0.02 |
| USD | 175,000 | MATTHEWS INTE 5.2500% 01/12/25 144A | 175,000 | 167,563 | 0.02 |
| USD | 157,000 | RADIAN GROUP INC 7% 15/03/21 | 157,000 | 166,420 | 0.02 |
| USD | 175,000 | CD&R WATERWOR 6.1250% 15/08/25 144A | 175,000 | 165,813 | 0.02 |
| USD | 175,000 | B&G FOODS INC 5.25% 01/04/25 | 175,000 | 164,938 | 0.02 |
| USD | 160,000 | CDW LLC/FIN 5.5% 01/12/24 | 167,400 | 163,200 | 0.02 |
| USD | 175,000 | RRI ENERGY INC 7.875% 15/06/17 (2) | 170,078 | 163,188 | 0.02 |
| USD | 175,000 | UNITED RENTAL NA 4.8750% 15/01/28 | 174,417 | 162,531 | 0.02 |
| USD | 175,000 | RADIO ONE INC 9.25% 15/02/20 144A | 171,938 | 161,000 | 0.02 |
| USD | 200,000 | JONAH LLC/FIN 7.2500% 15/10/25 144A | 200,000 | 160,500 | 0.02 |
| USD | 160,000 | DISH DBS CORP 6.75% 01/06/21 | 163,689 | 160,200 | 0.02 |
| USD | 150,000 | PINNACLE FOODS 5.875% 15/01/24 WI | 150,000 | 157,969 | 0.02 |
| USD | 150,000 | MCDERMOTT ES 10.6250% 01/05/24 144A | 142,469 | 156,375 | 0.02 |
| USD | 155,000 | FLEX ACQUIS 7.8750% 15/07/26 144A | 155,100 | 153,934 | 0.02 |
| USD | 150,000 | GREAT LAKES DRED 8.0000% 15/05/22 | 150,563 | 153,375 | 0.02 |
| USD | 150,000 | TMS INTL CORP 7.2500% 15/08/25 144A | 150,000 | 153,375 | 0.02 |
| USD | 150,000 | AMSURG CORP 5.625% 15/07/22 | 150,000 | 153,000 | 0.02 |
| USD | 150,000 | VPI ESCROW CORP 6.375% 15/10/20 144 | 152,700 | 152,391 | 0.02 |
| USD | 160,000 | PROJECT HOMESTAKE 8.875% 1/3/23 144 | 155,603 | 152,200 | 0.02 |
| USD | 150,000 | WEATHERFORD L 9.8750% 01/03/25 144A | 149,010 | 150,750 | 0.02 |
| USD | 150,000 | KB HOME 4.75% 15/05/19 | 150,000 | 150,383 | 0.02 |
| USD | 150,000 | GANNETT CO 4.875% 15/09/21 144A | 147,797 | 150,188 | 0.02 |
| USD | 140,000 | SUMMIT MAT 8.5% 15/04/22 | 140,525 | 149,989 | 0.02 |
| USD | 150,000 | FIRST CASH FIN 5.375% 01/06/24 144A | 150,000 | 149,625 | 0.02 |
| USD | 140,000 | DYNEGY INC 7.625% 01/11/24 WI | 134,863 | 149,450 | 0.02 |
| USD | 150,000 | REALOGY GROUP 5.25% 01/12/21 144A | 150,170 | 149,250 | 0.02 |
| USD | 150,000 | TENNANT CO 5.6250% 01/05/25 | 150,000 | 148,875 | 0.02 |
| USD | 150,000 | CNG HLDG INC 9.375% 15/05/20 144A | 133,138 | 148,875 | 0.02 |
| USD | 150,000 | HARLAND CLARKE 8.375% 15/08/22 144A | 150,000 | 146,250 | 0.02 |
| USD | 150,000 | CSTN MERGER S 6.7500% 15/08/24 144A | 150,000 | 146,250 | 0.02 |
| USD | 150,000 | BUILDERS FIRSTS 5.625% 1/09/24 144A | 149,375 | 145,875 | 0.02 |
| USD | 150,000 | COEUR MINING INC 5.8750% 01/06/24 | 150,000 | 144,750 | 0.02 |
| USD | 145,000 | ADVANCED DISP 5.625% 15/11/24 144A | 146,676 | 144,594 | 0.02 |
| USD | 283,000 | CHS/COMM HEALTH 6.875% 01/02/22 WI | 201,256 | 144,330 | 0.02 |
| USD | 150,000 | GENESIS ENERGY 6.5000% 01/10/25 | 150,000 | 144,000 | 0.02 |
| USD | 150,000 | BEAZER HOMES USA 6.7500% 15/03/25 | 150,000 | 143,250 | 0.02 |
| USD | 145,000 | SPECTRUM BRANDS 5.75% 15/07/25 | 145,094 | 143,188 | 0.02 |
| USD | 150,000 | TERRAFORM POW 5.0000% 31/01/28 144A | 150,000 | 142,500 | 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 | 125,000 | WILLIAMS COS 7.875% 01/09/21 | 104,026 | 139,063 | 0.02 |
| USD | 150,000 | IRON MOUNTAIN 5.2500% 15/03/28 144A | 145,125 | 138,810 | 0.02 |
| USD | 150,000 | VINE OIL & GA 8.7500% 15/04/23 144A | 140,688 | 138,000 | 0.02 |
| USD | 125,000 | WEIGHT WATCHE 8.6250% 01/12/25 144A | 127,760 | 137,500 | 0.02 |
| USD | 150,000 | CHS/COMMUNITY STUP 30/06/23 144A | 139,313 | 135,000 | 0.02 |
| USD | 115,000 | SPRINT NEXTEL CORP 11.5% 15/11/21 | 119,115 | 134,838 | 0.02 |
| USD | 135,000 | JAGUAR HL/PPDI 6.375% 01/08/23 144A | 140,569 | 134,325 | 0.02 |
| USD | 130,000 | NETFLIX INC 5.75% 01/03/24 | 139,106 | 133,263 | 0.02 |
| USD | 130,000 | W/S PACKAGING 9.0000% 15/04/23 144A | 130,869 | 132,600 | 0.02 |
| USD | 124,000 | KINDRED HEALTH 8.75% 15/01/23 | 128,645 | 132,138 | 0.02 |
| USD | 140,000 | HEXION US FIN 6.625% 15/04/20 WI | 128,919 | 131,600 | 0.02 |
| USD | 125,000 | NAVIENT CORP 7.25% 25/09/23 | 124,996 | 130,431 | 0.02 |
| USD | 125,000 | CSC HOLDINGS LLC 8.625% 15/02/19 | 138,438 | 128,594 | 0.01 |
| USD | 120,000 | ALTA MESA HLDGS 7.8750% 15/12/24 WI | 124,350 | 127,500 | 0.01 |
| USD | 125,000 | FIVE PT OP CO 7.8750% 15/11/25 144A | 125,000 | 127,188 | 0.01 |
| USD | 120,000 | DIAMOND 1/2 FIN 7.125% 15/06/24 144 | 129,300 | 127,131 | 0.01 |
| USD | 125,000 | OXFORD FIN/COS 6.3750% 15/12/22 | 125,000 | 126,875 | 0.01 |
| USD | 125,000 | VERSUM MATERIALS 5.5% 30/09/24 144A | 125,000 | 126,738 | 0.01 |
| USD | 125,000 | CEDAR FAIR/CANA 5.375% 01/06/24 WI | 128,125 | 126,250 | 0.01 |
| USD | 125,000 | WILLIAMS CO INC 4.55% 24/06/24 | 86,452 | 125,000 | 0.01 |
| USD | 150,000 | CENTURYTEL INC 7.6% 15/09/39 P | 130,500 | 124,500 | 0.01 |
| USD | 125,000 | WMG ACQUISITION 5% 01/08/23 144A | 125,000 | 124,375 | 0.01 |
| USD | 200,000 | JONES ENERGY 9.25% 15/03/23 | 184,000 | 124,000 | 0.01 |
| USD | 125,000 | ICAHN ENTER/FIN 6.3750% 15/12/25 WI | 125,000 | 123,913 | 0.01 |
| USD | 125,000 | WMG ACQUISITI 5.5000% 15/04/26 144A | 125,000 | 123,906 | 0.01 |
| USD | 130,000 | UNITED RENTAL NA 4.6250% 15/10/25 | 130,000 | 123,825 | 0.01 |
| USD | 125,000 | PENSKE AUTO GRP 3.7500% 15/08/20 | 125,000 | 123,750 | 0.01 |
| USD | 115,000 | DYNEGY INC 8% 15/01/25 144A | 125,638 | 123,481 | 0.01 |
| USD | 125,000 | AMERIGAS FIN 5.625% 20/05/24 | 125,000 | 122,969 | 0.01 |
| USD | 125,000 | LITHIA MOTORS 5.2500% 01/08/25 144A | 125,000 | 121,875 | 0.01 |
| USD | 125,000 | GULFPORT ENERGY 6.3750% 15/01/26 WI | 125,000 | 121,563 | 0.01 |
| USD | 127,000 | WINDSTREAM SR 8.6250% 31/10/25 144A | 123,579 | 120,650 | 0.01 |
| USD | 125,000 | STARWOOD PROP 4.7500% 15/03/25 144A | 124,061 | 120,625 | 0.01 |
| USD | 125,000 | SM ENERGY CO 5.625% 01/06/25 | 123,438 | 119,688 | 0.01 |
| USD | 125,000 | OLIN CORP 5.0000% 01/02/30 | 125,313 | 118,125 | 0.01 |
| USD | 125,000 | RBS GLOBAL/RE 4.8750% 15/12/25 144A | 125,000 | 117,500 | 0.01 |
| USD | 125,000 | QTS LP/FINANC 4.7500% 15/11/25 144A | 125,000 | 116,800 | 0.01 |
| USD | 125,000 | BERRY GLOBAL 4.5000% 15/02/26 144A | 125,000 | 116,563 | 0.01 |
| USD | 125,000 | VALEANT PHARM 5.5% 01/03/23 144A | 116,094 | 116,406 | 0.01 |
| USD | 115,000 | MGM GROWTH/FIN 5.625% 1/05/24 | 120,584 | 116,150 | 0.01 |
| USD | 125,000 | PLASTIPAK HOL 6.2500% 15/10/25 144A | 125,000 | 115,000 | 0.01 |
| USD | 115,000 | SPRINT CAP CORP 6.875% 15/11/28 | 110,638 | 109,825 | 0.01 |
| USD | 100,000 | CHENIERE CORP CHRIS 7% 30/6/24 WI | 112,500 | 109,125 | 0.01 |
| USD | 175,000 | JONES ENERGY 6.75% 01/04/22 | 144,125 | 108,500 | 0.01 |
| USD | 100,000 | TERRAFORM POWER 6.125% 15/06/25 144 | 77,750 | 106,500 | 0.01 |
| USD | 125,000 | DISH DBS CORP 5.875% 15/11/24 | 109,175 | 106,094 | 0.01 |
| USD | 105,000 | TSGI DUMMY 7.0000% 30/06/26 | 105,000 | 105,000 | 0.01 |
| USD | 100,000 | EXTRACTION OI 7.3750% 15/05/24 144A | 100,000 | 104,750 | 0.01 |
| USD | 100,000 | HCA INC 5.875% 15/03/22 | 107,750 | 104,125 | 0.01 |
| USD | 100,000 | T-MOBILE USA INC 6% 01/03/23 | 101,765 | 103,125 | 0.01 |
| USD | 100,000 | TESORO LOGISTICS 5.25% 15/01/25 | 100,000 | 102,625 | 0.01 |
| USD | 100,000 | NETFLIX INC 5.375% 01/02/21 | 103,125 | 102,500 | 0.01 |
| USD | 100,000 | CIT GROUP INC 5% 01/08/23 | 104,125 | 101,160 | 0.01 |
| USD | 100,000 | VALVOLINE FINCO 5.5000% 15/07/24 WI | 100,000 | 101,000 | 0.01 |
| USD | 100,000 | CCO HDGS LLC/CAP 5.25% 30/09/22 | 102,000 | 100,470 | 0.01 |
| USD | 100,000 | DR HORTON INC 3.75% 01/03/19 | 100,000 | 100,313 | 0.01 |
| USD | 100,000 | BILL BARRETT CORP 7% 15/10/22 | 79,000 | 100,000 | 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 | 100,000 | DIAMONDBACK E 5.3750% 31/05/25 144A | 104,000 | 99,750 | 0.01 |
| USD | 100,000 | BLOCK COMM INC 6.875% 15/02/25 144A | 100,000 | 99,750 | 0.01 |
| USD | 100,000 | TEREX CORP 5.625% 01/02/25 144A | 100,000 | 99,500 | 0.01 |
| USD | 100,000 | LIVE NATION E 5.6250% 15/03/26 144A | 100,000 | 99,250 | 0.01 |
| USD | 100,000 | PQ CORP 5.7500% 15/12/25 144A | 100,000 | 99,000 | 0.01 |
| USD | 100,000 | DISH DBS CORP 5.125% 01/05/20 | 99,856 | 99,000 | 0.01 |
| USD | 175,000 | JC PENNEY CORP INC 6.375% 15/10/36 | 119,625 | 98,875 | 0.01 |
| USD | 100,000 | CDW LLC/FIN 5% 01/09/25 | 100,000 | 98,250 | 0.01 |
| USD | 100,000 | FERRELLGAS 8.6250% 15/06/20 | 96,000 | 96,750 | 0.01 |
| USD | 175,000 | REVLON CONS PROD 6.25% 01/08/24 | 176,264 | 96,688 | 0.01 |
| USD | 100,000 | FRONTIER COMM 8.5000% 01/04/26 144A | 99,965 | 96,529 | 0.01 |
| USD | 100,000 | ENERGY TRANS 4.2500% 15/03/23 | 99,750 | 96,500 | 0.01 |
| USD | 100,000 | UNITI / CSL 6% 15/04/23 144 | 99,250 | 96,000 | 0.01 |
| USD | 100,000 | DIEBOLD INC 8.5% 15/04/24 WI | 100,000 | 95,783 | 0.01 |
| USD | 100,000 | DENBURY RESOURCES 6.375% 15/08/21 | 85,750 | 95,750 | 0.01 |
| USD | 100,000 | SILGAN HOLDINGS 4.7500% 15/03/25 WI | 100,000 | 95,000 | 0.01 |
| USD | 100,000 | AMER WOODMARK 4.8750% 15/03/26 144A | 100,000 | 94,750 | 0.01 |
| USD | 90,000 | DIAMOND 1/2 FIN 6.02% 15/06/26 144 | 96,087 | 94,583 | 0.01 |
| USD | 100,000 | PILGRIM'S PRI 5.8750% 30/09/27 144A | 100,000 | 92,750 | 0.01 |
| USD | 100,000 | ENDO FIN LLC/FINCO 7.25% 15/01/22 1 | 96,125 | 92,000 | 0.01 |
| USD | 110,000 | NEW ALBERTSONS INC 8% 01/05/31 | 108,028 | 91,575 | 0.01 |
| USD | 95,000 | RADIATE HOLDC 6.8750% 15/02/23 144A | 94,050 | 91,200 | 0.01 |
| USD | 95,000 | DISH DBS CORP 5.875% 15/07/22 | 98,910 | 89,300 | 0.01 |
| USD | 100,000 | TESLA INC 5.3000% 15/08/25 144A | 90,688 | 89,250 | 0.01 |
| USD | 115,000 | EP ENER/EVER 8% 15/02/25 144A | 114,775 | 89,125 | 0.01 |
| USD | 85,000 | CHESAPEAKE ENRG 8.0000% 15/06/27 WI | 84,914 | 86,488 | 0.01 |
| USD | 90,000 | AK STEEL CORP 7% 15/03/27 | 90,000 | 85,500 | 0.01 |
| USD | 100,000 | JC PENNEY COR 8.6250% 15/03/25 144A | 100,000 | 84,750 | 0.01 |
| USD | 75,000 | EMI MUSIC PUB 7.625% 15/6/24 144A | 75,000 | 81,161 | 0.01 |
| USD | 100,000 | WEATHERFORD INTL 6.8% 15/06/37 | 85,929 | 80,000 | 0.01 |
| USD | 80,000 | CNO FINANCIAL GROUP 5.25% 30/05/25 | 81,040 | 79,400 | 0.01 |
| USD | 75,000 | GRINDING MED 7.375% 15/12/23 144A | 80,250 | 78,000 | 0.01 |
| USD | 75,000 | SOUTHWESTERN ENE 7.5000% 01/04/26 | 76,624 | 77,625 | 0.01 |
| USD | 75,000 | NAVIENT CORP 6.625% 26/07/21 | 75,000 | 77,040 | 0.01 |
| USD | 75,000 | CHESAPEAKE ENERGY 6.625% 15/08/20 | 79,500 | 76,875 | 0.01 |
| USD | 75,000 | SPRINT CORP 7.6250% 01/03/26 | 75,000 | 76,703 | 0.01 |
| USD | 75,000 | LUCENT TECH 6.4500% 15/03/29 | 78,094 | 76,688 | 0.01 |
| USD | 75,000 | DELL INC 5.8750% 15/06/19 | 77,719 | 76,594 | 0.01 |
| USD | 75,000 | SPRINT NEXTEL 9% 15/11/18 144A | 76,838 | 76,408 | 0.01 |
| USD | 75,000 | SESI LLC 7.125% 15/12/21 WI | 76,969 | 76,313 | 0.01 |
| USD | 75,000 | HILL-ROM HDG INC 5.75% 01/09/23 144 | 75,000 | 76,313 | 0.01 |
| USD | 75,000 | ICAHN ENTS FIN 5.875% 01/02/22 | 67,305 | 75,094 | 0.01 |
| USD | 75,000 | TUTOR PERINI 6.875% 01/05/25 144A | 75,000 | 75,094 | 0.01 |
| USD | 75,000 | NATIONSTAR MORT DU 0.0000% 30/06/23 | 75,000 | 75,000 | 0.01 |
| USD | 75,000 | TARGA RESOURCES 4.125% 15/11/19 | 75,000 | 75,000 | 0.01 |
| USD | 75,000 | NAVIENT CORP 5% 26/10/20 | 75,281 | 74,813 | 0.01 |
| USD | 75,000 | CLEAR CHAN WLD 7.625% 15/3/20 WI-B | 74,719 | 74,553 | 0.01 |
| USD | 75,000 | CIT GROUP INC 4.1250% 09/03/21 | 75,000 | 74,531 | 0.01 |
| USD | 75,000 | FIRST DATA CORP 5% 15/01/24 144A | 75,375 | 74,438 | 0.01 |
| USD | 75,000 | NIELSEN FIN LLC 5% 15/04/22 144A | 74,344 | 74,164 | 0.01 |
| USD | 75,000 | ASBURY AUTO 6% 15/12/24 | 78,188 | 73,875 | 0.01 |
| USD | 75,000 | NABORS INDUS 4.625% 15/09/21 | 74,438 | 73,313 | 0.01 |
| USD | 75,000 | BRISTOW GROUP 8.7500% 01/03/23 144A | 74,262 | 73,313 | 0.01 |
| USD | 75,000 | UNITED CONT HLDG 4.2500% 01/10/22 | 75,000 | 72,375 | 0.01 |
| USD | 75,000 | WABASH NATION 5.5000% 01/10/25 144A | 75,000 | 72,000 | 0.01 |
| USD | 75,000 | LENNAR CORP 5.0000% 15/06/27 | 75,000 | 71,813 | 0.01 |
| USD | 75,000 | SUNOCO LP/FIN 5.5000% 15/02/26 144A | 75,000 | 71,063 | 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 | 75,000 | ECLIPSE RESOURCES 8.875% 15/07/23 | 70,688 | 70,688 | 0.01 |
| USD | 75,000 | SIRIUS XM RAD 5.0000% 01/08/27 144A | 75,938 | 70,219 | 0.01 |
| USD | 172,000 | K HOVNANIAN E 5.0000% 01/02/40 144A | 112,757 | 69,123 | 0.01 |
| USD | 75,000 | GENON ENERGY INC 9.5% 15/10/18 (2) | 77,625 | 68,250 | 0.01 |
| USD | 65,000 | SPRINT CORP 7.25% 15/09/21 | 65,242 | 67,763 | 0.01 |
| USD | 75,000 | WINDSTREAM CORP 7.75% 15/10/20 | 60,000 | 67,313 | 0.01 |
| USD | 75,000 | L BRANDS INC 5.2500% 01/02/28 | 75,000 | 66,656 | 0.01 |
| USD | 70,000 | CB ESCROW 8.0000% 15/10/25 144A | 70,000 | 65,450 | 0.01 |
| USD | 75,000 | RITE AID CORP 7.7% 15/02/27 | 75,041 | 63,563 | 0.01 |
| USD | 65,000 | CINCINNATI BELL 7% 15/07/24 144A | 68,145 | 59,313 | 0.01 |
| USD | 50,000 | HCA HLDG 6.25% 15/02/21 | 53,000 | 51,875 | 0.01 |
| USD | 50,000 | NRG ENERGY 6.625% 15/01/27 WI | 51,688 | 51,375 | 0.01 |
| USD | 50,000 | ALLY FINANCIAL INC 8% 31/12/18 | 54,750 | 51,000 | 0.01 |
| USD | 55,000 | AK STEEL CORP 6.3750% 15/10/25 | 55,000 | 50,738 | 0.01 |
| USD | 50,000 | ANTERO RESOURCE FIN 5.375% 01/11/21 | 51,313 | 50,625 | 0.01 |
| USD | 50,000 | CCO HDGS LLC/CAP 5.25% 15/03/21 | 50,750 | 50,344 | 0.01 |
| USD | 50,000 | ANTERO RESOURCE 5.125% 1/12/22 | 43,500 | 50,125 | 0.01 |
| USD | 50,000 | KOPPERS INC 6% 15/02/25 144A | 50,000 | 50,000 | 0.01 |
| USD | 50,000 | FIRST DATA CORP 5.75% 15/01/24 144A | 50,500 | 50,000 | 0.01 |
| USD | 50,000 | CENTURLINK INC 5.8% 15/03/22 | 49,625 | 49,500 | 0.01 |
| USD | 50,000 | LENNAR CORP 5.2500% 01/06/26 | 49,250 | 49,000 | 0.01 |
| USD | 50,000 | ISTAR INC 5.2500% 15/09/22 | 50,000 | 48,250 | 0.01 |
| USD | 50,000 | TOPBUILD CORP 5.6250% 01/05/26 | 49,375 | 48,000 | 0.01 |
| USD | 50,000 | FREEPORT MCMORAN 3.55% 01/03/22 | 49,188 | 47,455 | 0.01 |
| USD | 50,000 | VOC ESCROW LT 5.0000% 15/02/28 144A | 50,000 | 47,236 | 0.01 |
| USD | 50,000 | SUMMIT MAT 5.125% 01/06/25 144A | 50,000 | 47,000 | 0.01 |
| USD | 50,000 | NEXTERA ENER 4.5000% 15/09/27 144A | 50,000 | 46,750 | 0.01 |
| USD | 100,000 | HIGH RIDGE BRANDS 8.875% 15/3/25 14 | 100,450 | 45,000 | 0.01 |
| USD | 44,000 | CARRIZO OIL&GAS INC 7.5% 15/09/20 | 46,382 | 44,275 | 0.01 |
| USD | 50,000 | PARKER DRILLING 7.5% 01/08/20 | 45,750 | 41,625 | 0.00 |
| USD | 46,000 | WINDSTREAM CORP 7.75% 01/10/21 | 37,643 | 36,915 | 0.00 |
| USD | 30,000 | POST HLDGS 5% 15/08/26 144A | 30,000 | 27,981 | 0.00 |
| USD | 25,000 | CARROLS REST GRP 8% 01/05/22 | 26,625 | 26,094 | 0.00 |
| USD | 25,000 | NRG ENERGY 6.25% 01/05/24 WI | 26,313 | 25,625 | 0.00 |
| USD | 25,000 | OASIS PETROLEUM 6.5% 01/11/21 | 25,563 | 25,500 | 0.00 |
| USD | 25,000 | STANDARD IND 5.5% 15/02/23 144A | 25,000 | 25,375 | 0.00 |
| USD | 25,000 | VALEANT PHARMA 6.75% 15/08/21 144A | 25,000 | 25,281 | 0.00 |
| USD | 25,000 | HCA INC 5.875% 15/02/26 | 25,500 | 25,219 | 0.00 |
| USD | 25,000 | CCO HDGS LLC/CAP 5.75% 15/01/24 | 25,188 | 25,063 | 0.00 |
| USD | 25,000 | LIFEPOINT HOSPI 5.5% 01/12/21 | 25,807 | 24,969 | 0.00 |
| USD | 25,000 | CCO HLDGS LLC/CAP 5.875% 01/5/27 14 | 24,656 | 24,406 | 0.00 |
| USD | 25,000 | QEP RESOURCES 5.6250% 01/03/26 | 25,000 | 23,938 | 0.00 |
| USD | 25,000 | ITRON INC 5.0000% 15/01/26 144A | 25,000 | 23,743 | 0.00 |
| USD | 25,000 | STANDARD INDS 4.7500% 15/01/28 144A | 25,000 | 22,938 | 0.00 |
| USD | 8,925,000 | NEWPAGE CORP 10% 01/05/12 ESCROW (2) | 5,161,232 | 5,578 | 0.00 |
| USD | 425,000 | APPVION INC 9% 01/06/20 144A (2) | 268,188 | 2,391 | 0.00 |
| USD | 275,000 | REE21 INC 9% 15/10/21 144A (2) | 225,862 | 688 | 0.00 |
| USD | 675,000 | TEXAS COMPETIT ESC 11.5% 1/10/20 14 | 0 | 7 | 0.00 |
| USD | 1,000,000 | HAWKER BEECHCRAFT 9.75% 01/4/17 ESC (2) | 597,500 | 0 | 0.00 |
| USD | 175,000 | QUEBECO 9.125% 15/08/19 ESCROW (2) | 179,135 | 0 | 0.00 |
| USD | 1,400,000 | MIDWAY GAMES CV 9.25% ESC 01/06/21 (2) | 0 | 0 | 0.00 |
| USD | 250,000 | SEVENTY SEVEN ENER ESC 6.5% 15/7/22 (2) | 0 | 0 | 0.00 |
| USD | 675,000 | SANDRIDGE ENERGY ESC 7.5% 15/03/21 (2) | 0 | 0 | 0.00 |
| USD | 250,000 | AVETA INC ESCW 144A 9% 0% 01/04/19 (2) | 202,500 | 0 | 0.00 |
| USD | 175,000 | MIDWAY GAMES CV 10.75% 01/10/20 DFT (2) | 0 | 0 | 0.00 |
| USD | 275,000 | AVETA INC ESCROW INC 7% 0% 01/04/19 (2) | 222,938 | 0 | 0.00 |
| | | | 231,071,073 | 220,774,954 | 25.68 |

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(%) |
|--------------------|----------------------------|---|--------------------|--------------------|--------------|
| 優先証券 | | | | | |
| — | 53,500 | GMAC CAP TST I PFD FRN 15/02/40 | 1,311,461 | 1,398,490 | 0.16 |
| — | 8,450 | GENERAL FIN PFD 8.125% 31/07/21 | 211,250 | 219,151 | 0.03 |
| — | 177 | NINE POINT ENERGY HOLDINGS PFD DUMM | 177,000 | 115,050 | 0.01 |
| | | | <u>1,699,711</u> | <u>1,732,691</u> | <u>0.20</u> |
| ワラント | | | | | |
| — | 2,626,883 | IPAYMENT WTS22 | 1,813,792 | 669,856 | 0.08 |
| — | 3,209 | HALCON RESOURCES WTS 2020 | 14,202 | 1,332 | 0.00 |
| — | 1,319 | SANDRIDGE ENERGY INC WTS 2022 | 0 | 369 | 0.00 |
| — | 555 | SANDRIDGE ENERGY INC WTS 2022 | 0 | 144 | 0.00 |
| — | 5,215 | MIDSTATES PETROLEUM CO INC WTS 2020 | 405,903 | 26 | 0.00 |
| — | 150,000 | NOVASEP HOLDINGS WTS 31/05/19 | 7,513 | 0 | 0.00 |
| | | | <u>2,241,410</u> | <u>671,727</u> | <u>0.08</u> |
| | | 合計：アメリカ | <u>263,401,819</u> | <u>242,172,671</u> | <u>28.17</u> |
| ウルグアイ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 223,326 | URUGUAY 4.9750% 20/04/55 | 220,452 | 216,626 | 0.03 |
| USD | 73,000 | REP OF URUGUAY 7.875% PK 15/01/33 | 102,259 | 95,630 | 0.01 |
| | | | <u>322,711</u> | <u>312,256</u> | <u>0.04</u> |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 700,000 | REP ORIENT URUGUAY 5.1% 18/06/50 | 738,049 | 689,500 | 0.08 |
| USD | 500,000 | REP OF URUGUAY 4.375% 27/10/27 | 509,292 | 506,250 | 0.06 |
| USD | 141,000 | REP ORIENT URUGUAY 7.625% 21/03/36 | 194,490 | 182,595 | 0.02 |
| | | | <u>1,441,831</u> | <u>1,378,345</u> | <u>0.16</u> |
| | | 合計：ウルグアイ | <u>1,764,542</u> | <u>1,690,601</u> | <u>0.20</u> |
| ベネズエラ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 2,282,000 | REP OF VENEZUELA 9.25% 7/5/28 (2) | 1,598,226 | 616,139 | 0.08 |
| USD | 1,651,000 | BOL REP OF VZLA 8.25% 13/10/24 REGS (2) | 955,796 | 447,834 | 0.05 |
| USD | 1,150,000 | REP OF VENEZUELA 7.75% 13/10/19 REG (2) | 693,231 | 303,313 | 0.04 |
| USD | 790,000 | REP OF VENEZUELA 7.65% 21/04/25 (2) | 386,767 | 211,325 | 0.02 |
| USD | 540,000 | REP OF VENEZUELA 9.25% 15/09/27 (2) | 380,887 | 153,225 | 0.02 |
| USD | 438,000 | REP OF VENEZUELA 11.75% 21/10/26 (2) | 240,733 | 123,734 | 0.01 |
| USD | 438,000 | REP OF VENEZUELA 9% 07/05/23 (2) | 324,671 | 119,355 | 0.01 |
| | | | <u>4,580,311</u> | <u>1,974,925</u> | <u>0.23</u> |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 788,000 | PETROLEOS DE VENEZ 8.5% 27/10/20 RE (2) | 359,961 | 509,737 | 0.06 |
| USD | 1,780,000 | PETROLEOS VENEZU 6% 15/11/26 REGS (2) | 539,825 | 372,019 | 0.04 |
| USD | 1,125,300 | REP OF VENEZUELA 11.95% 5/8/31 | 579,341 | 316,491 | 0.04 |
| USD | 820,000 | PETROLEOS VENEZ 6% 16/05/24 REGS (2) | 259,850 | 173,020 | 0.02 |
| USD | 374,000 | BOL REP OF VZLA 12.75% 23/08/22 (2) | 299,625 | 105,936 | 0.01 |
| USD | 199,207 | PETROLEOS VENEZ 9.75% 17/05/35 REGS (2) | 109,688 | 47,063 | 0.01 |
| USD | 192,678 | PETROLEOS VENEZU 9% 17/11/21 REGS (2) | 76,010 | 46,744 | 0.01 |
| USD | 155,000 | PETROLEOS VENEZU 12.75% 17/02/22 RE | 163,243 | 39,835 | 0.00 |
| | | | <u>2,387,543</u> | <u>1,610,845</u> | <u>0.19</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 705,000 | PETROLEOS DE VEN 5.5% 12/04/37 (2) | 214,254 | 156,863 | 0.02 |
| | | | <u>214,254</u> | <u>156,863</u> | <u>0.02</u> |
| | | 合計：ベネズエラ | <u>7,182,108</u> | <u>3,742,633</u> | <u>0.44</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(%) |
|-------------|----------------------------|-----------------------------------|--------------------|--------------------|--------------|
| ベトナム | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 319,000 | REP OF VIETNAM 4.8% 19/11/24 REGS | 319,000 | 317,456 | 0.04 |
| USD | 165,000 | REP SOCIAL VIETNAM 6.75% 29/1/20 | 189,258 | 170,975 | 0.02 |
| | | | <u>508,258</u> | <u>488,431</u> | <u>0.06</u> |
| | | 合計：ベトナム | <u>508,258</u> | <u>488,431</u> | <u>0.06</u> |
| ザンビア | | | | | |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 502,000 | REP OF ZAMBIA 8.97% 30/07/27 REGS | 534,948 | 444,270 | 0.05 |
| | | | <u>534,948</u> | <u>444,270</u> | <u>0.05</u> |
| | | 合計：ザンビア | <u>534,948</u> | <u>444,270</u> | <u>0.05</u> |
| | | 組入資産合計 | <u>832,487,099</u> | <u>788,367,166</u> | <u>91.74</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

(2) 債務不履行証券

財務書類に関する注記

2018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

2018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) |
|------|---------------|------|-------------|------------|-------------|
| AUD | 57,182 | USD | 43,510 | 2018年7月17日 | (1,279) |
| ZAR | 572,984 | USD | 43,510 | 2018年7月17日 | (1,896) |
| BRL | 76,037,383 | USD | 20,071,049 | 2018年8月2日 | (463,241) |
| BRL | 114,962,338 | USD | 30,500,000 | 2018年8月2日 | (854,590) |
| BRL | 202,771,634 | USD | 53,500,000 | 2018年8月2日 | (1,211,152) |
| BRL | 201,105,697 | USD | 53,300,000 | 2018年8月2日 | (1,440,748) |
| BRL | 198,831,012 | USD | 53,300,000 | 2018年8月2日 | (2,027,322) |
| USD | 886,403 | BRL | 3,332,934 | 2018年8月2日 | 26,938 |
| USD | 439,606 | ZAR | 5,845,626 | 2018年7月17日 | 15,053 |
| USD | 439,606 | AUD | 579,503 | 2018年7月17日 | 11,620 |
| USD | 443,201 | ZAR | 6,021,964 | 2018年7月31日 | 6,648 |
| USD | 443,201 | ZAR | 6,011,258 | 2018年7月17日 | 6,618 |
| USD | 443,201 | AUD | 596,872 | 2018年7月17日 | 2,387 |
| USD | 443,201 | AUD | 596,860 | 2018年7月31日 | 2,378 |
| USD | 195,832 | JPY | 21,404,032 | 2018年7月17日 | 2,108 |
| USD | 195,832 | JPY | 21,383,721 | 2018年7月31日 | 2,103 |
| USD | 180,883 | JPY | 19,813,297 | 2018年7月17日 | 1,557 |
| USD | 186,207 | JPY | 20,432,545 | 2018年7月17日 | 1,277 |
| USD | 168,085 | JPY | 18,435,385 | 2018年7月17日 | 1,230 |
| USD | 168,085 | JPY | 18,418,019 | 2018年7月31日 | 1,225 |
| USD | 44,567 | BRL | 168,914 | 2018年8月2日 | 1,010 |
| USD | 22,283 | ZAR | 302,856 | 2018年7月31日 | 329 |
| USD | 22,283 | ZAR | 302,317 | 2018年7月17日 | 327 |
| USD | 22,283 | AUD | 30,028 | 2018年7月17日 | 107 |
| USD | 22,283 | AUD | 30,028 | 2018年7月31日 | 106 |
| JPY | 6,001,516,373 | USD | 54,627,071 | 2018年7月31日 | (255,443) |
| AUD | 160,956,555 | USD | 119,288,122 | 2018年7月31日 | (410,379) |
| JPY | 5,135,515,912 | USD | 47,044,531 | 2018年7月17日 | (563,906) |
| ZAR | 1,593,207,143 | USD | 116,915,155 | 2018年7月31日 | (1,417,772) |
| AUD | 133,510,152 | USD | 101,386,007 | 2018年7月17日 | (2,783,345) |
| ZAR | 1,368,862,562 | USD | 103,351,910 | 2018年7月17日 | (3,934,586) |
| USD | 73,021,736 | EUR | 61,813,000 | 2018年7月17日 | 1,079,567 |
| USD | 168,075,833 | EUR | 143,609,266 | 2018年7月31日 | 756,789 |
| USD | 14,245,757 | GBP | 10,626,000 | 2018年7月17日 | 299,593 |
| USD | 10,669,040 | GBP | 8,031,334 | 2018年7月31日 | 121,360 |
| USD | 185,639 | EUR | 157,000 | 2018年7月17日 | 2,912 |
| USD | 327,891 | EUR | 280,000 | 2018年7月31日 | 1,663 |
| USD | 99,055 | EUR | 84,000 | 2018年7月17日 | 1,291 |
| USD | 251,257 | EUR | 215,000 | 2018年7月17日 | 1,026 |
| EUR | 231,000 | USD | 267,962 | 2018年7月17日 | 891 |
| EUR | 371,000 | USD | 430,929 | 2018年7月17日 | 866 |

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 | 66,469 | GBP | 50,000 | 2018年7月31日 | 804 |
| USD | 105,400 | EUR | 90,000 | 2018年7月31日 | 541 |
| USD | 50,387 | GBP | 38,000 | 2018年7月17日 | 515 |
| GBP | 239,000 | USD | 313,257 | 2018年7月17日 | 420 |
| EUR | 350,000 | USD | 407,312 | 2018年7月17日 | 41 |
| USD | 51,204 | EUR | 44,000 | 2018年7月17日 | (6) |
| EUR | 198,000 | USD | 230,528 | 2018年7月17日 | (83) |
| USD | 70,728 | EUR | 61,000 | 2018年7月17日 | (267) |
| EUR | 571,000 | USD | 666,271 | 2018年7月17日 | (1,703) |
| EUR | 315,000 | USD | 368,727 | 2018年7月17日 | (2,109) |
| USD | 655,577 | EUR | 567,000 | 2018年7月17日 | (4,335) |
| INR | 2,389,903,016 | USD | 35,366,674 | 2018年7月26日 | (593,568) |
| CNY | 225,046,435 | USD | 34,897,953 | 2018年9月28日 | (989,341) |
| IDR | 504,710,737,862 | USD | 36,128,184 | 2018年7月26日 | (1,000,494) |
| | | | | | (15,606,265) |

注記2－先物契約

2018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 | | | | | |
| USD | 24 | FUT US ULTRA BOND 30YR 6% | 2018年9月 | 3,838,500 | 24,750 |
| USD | 50 | FUT US NOTE 2YR 6% | 2018年9月 | 10,590,625 | (27,095) |
| USD | 92 | FUT US NOTE 5YR 6% | 2018年9月 | 10,450,625 | (79,817) |
| | | | | 24,879,750 | (82,162) |
| 売り持ちポジション | | | | | |
| USD | (108) | FUT US ULTRA NOTE 10YR 6% | 2018年9月 | (13,854,375) | 8,847 |
| EUR | (1) | FUT EURO BUND 10YR 6% | 2018年9月 | (188,990) | (2,063) |
| GBP | (23) | FUT LONG GILT 10YR 4% | 2018年9月 | (3,711,317) | (33,931) |
| USD | (10) | FUT US LONG BD 20YR 6% | 2018年9月 | (1,452,500) | (3,867) |
| USD | (81) | FUT US NOTE 10YR 6% | 2018年9月 | (9,735,188) | (2,078) |
| | | | | (28,942,370) | (33,092) |
| | | | | | (115,254) |

注記3－クレジット・デフォルト・スワップ契約

2018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 | | | | |
| EUR | 1,000,000 | CDS ALTICE FINCO 5Y 5% 20/06/2023 | 2023年6月20日 | (13,796) |
| USD | 4,170,000 | CDS FED REP BRAZIL 1% 5Y 20/06/23 | 2023年6月20日 | 300,650 |
| EUR | 1,000,000 | CDX ITRAXX XOVER S29 5Y 5% 20/06/23 | 2023年6月20日 | (93,097) |
| | | | | 193,757 |
| プロテクション売りポジション | | | | |
| EUR | 500,000 | CDS WIND ACQUISITION 500BP 20/12/21 | 2021年12月20日 | 75,379 |
| | | | | 75,379 |
| | | | | 269,136 |

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第17期（決算日2019年8月19日）

作成対象期間（2018年8月21日～2019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 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|-----|------|-------|--------|--------|
| | | 期騰 | 中率 | | | |
| | 円 | | % | % | % | 百万円 |
| 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 |
| 15期(2017年8月21日) | 10,208 | | △0.0 | 64.0 | — | 17,754 |
| 16期(2018年8月20日) | 10,206 | | △0.0 | 38.7 | — | 13,511 |
| 17期(2019年8月19日) | 10,205 | | △0.0 | 59.3 | — | 8,458 |

*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

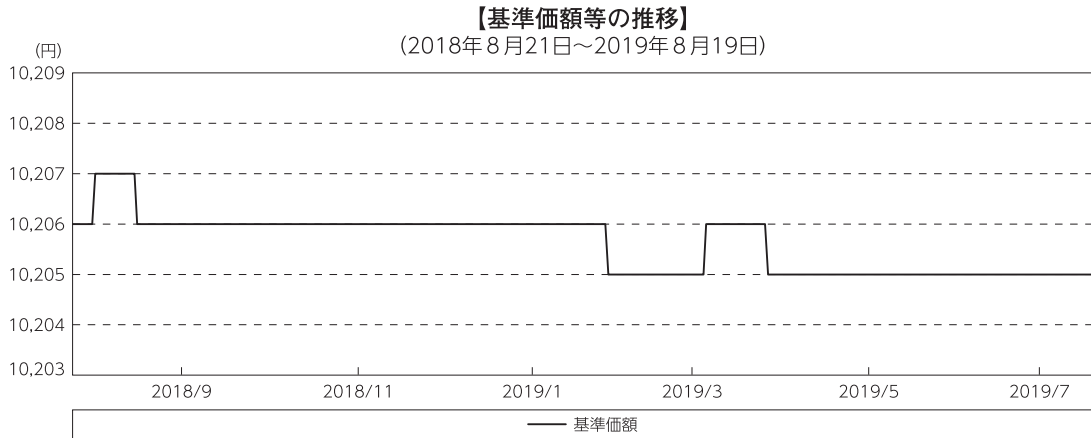
| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | | 債組入比率 | 債券先物比率 | 債券率 |
|--------------------|-------------|-----|--------|-------|-----------|--------|
| | | 騰 | 落 | | | |
| (期首) 2018年8月20日 | 円 10,206 | | % — | | % 38.7 | % — |
| 8月末 | 10,207 | | 0.0 | | 40.6 | — |
| 9月末 | 10,206 | | 0.0 | | 52.5 | — |
| 10月末 | 10,206 | | 0.0 | | 53.1 | — |
| 11月末 | 10,206 | | 0.0 | | 41.5 | — |
| 12月末 | 10,206 | | 0.0 | | 51.0 | — |
| 2019年1月末 | 10,206 | | 0.0 | | 51.1 | — |
| 2月末 | 10,205 | | △0.0 | | 55.7 | — |
| 3月末 | 10,205 | | △0.0 | | 64.2 | — |
| 4月末 | 10,205 | | △0.0 | | 54.0 | — |
| 5月末 | 10,205 | | △0.0 | | 65.5 | — |
| 6月末 | 10,205 | | △0.0 | | 61.8 | — |
| 7月末 | 10,205 | | △0.0 | | 57.8 | — |
| (期末) 2019年8月19日 | 10,205 | | △0.0 | | 59.3 | — |

*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やコール・ローンなどのマイナス金利環境を要因とする支払利息等。

○投資環境

国内経済は、高水準にある企業収益や雇用・所得環境の改善継続等を背景に、緩やかな回復基調が続いたものの、海外経済の減速から輸出や生産に弱含みの動きもみられました。

このような中、日本銀行は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続し、2019年4月には「政策金利のフォワードガイダンス」をより明確に示すため、少なくとも2020年春頃まで現在のきわめて低い長短金利の水準を維持することとしました。

マイナス金利政策のもと、T-Bill（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは、2018年9月まで概ね-0.1%台で推移し、10月以降は良好な円調達環境を受け海外投資家等により買込まれ-0.3%台まで低下、その後期末にかけては-0.1%台まで上昇しました。また、無担保コール翌日物金利は期を通して概ね-0.06～-0.07%程度で推移しました。

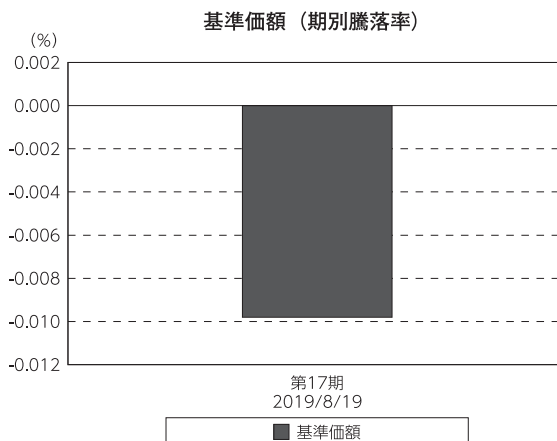
○当ファンドのポートフォリオ

残存1年以内の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

残存1年以内の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いたします。

日本銀行によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

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

(2018年8月21日～2019年8月19日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2018年8月21日～2019年8月19日)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|---|----------------|------------|-------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 | 国債証券 | 6,812,723 | 6,812,701 |
| | 地方債証券 | 2,994,475 | — (2,452,000) |
| 内 | 特殊債券 | 5,906,659 | — (7,940,000) |
| | 社債券(投資法人債券を含む) | 11,495,778 | — (10,167,000) |

*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す。

*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 |
|---|-------------|-----------|------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 内 | コマーシャル・ペーパー | 4,699,986 | — (8,600,000) |

*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

(2018年8月21日～2019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 | | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | |
|-----|---------------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | $\frac{B}{A}$ | | | $\frac{D}{C}$ |
| 公社債 | 百万円 20,396 | 百万円 1,141 | % 5.6 | 百万円 - | 百万円 - | % - |

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です。

○組入資産の明細

(2019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 | 1,156,000 (1,156,000) | 1,157,903 (1,157,903) | 13.7 (13.7) | - (-) | - (-) | - (-) | 13.7 (13.7) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 700,000 (700,000) | 700,671 (700,671) | 8.3 (8.3) | - (-) | - (-) | - (-) | 8.3 (8.3) |
| 金融債券 | 350,000 (350,000) | 350,021 (350,021) | 4.1 (4.1) | - (-) | - (-) | - (-) | 4.1 (4.1) |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 2,800,000 (2,800,000) | 2,804,925 (2,804,925) | 33.2 (33.2) | - (-) | - (-) | - (-) | 33.2 (33.2) |
| 合 計 | 5,006,000 (5,006,000) | 5,013,521 (5,013,521) | 59.3 (59.3) | - (-) | - (-) | - (-) | 59.3 (59.3) |

* ()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 | 利 率 | 当 期 末 | |
|------------------------------|-------|-----------|-----------|
| | | 額 面 金 額 | 評 価 額 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 |
| 大阪府 公募第330回 | 1.48 | 116,000 | 116,173 |
| 大阪府 公募第331回 | 1.41 | 100,000 | 100,269 |
| 兵庫県 公募平成21年度第23回 | 1.37 | 100,000 | 100,218 |
| 静岡県 公募平成21年度第4回 | 1.56 | 100,000 | 100,007 |
| 静岡県 公募平成21年度第5回 | 1.35 | 100,000 | 100,222 |
| 広島県 公募平成21年度第3回 | 1.41 | 140,000 | 140,196 |
| 福岡県 公募平成26年度第4回 | 0.135 | 100,000 | 100,016 |
| 岐阜県 公募平成21年度第1回 | 1.35 | 100,000 | 100,256 |
| 共同発行市場地方債 公募第79回 | 1.34 | 100,000 | 100,246 |
| 広島市 公募平成21年度第2回 | 1.35 | 100,000 | 100,262 |
| 鹿児島県 公募(5年)平成26年度第1回 | 0.153 | 100,000 | 100,034 |
| 小 計 | | 1,156,000 | 1,157,903 |
| 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46回 | 0.219 | 100,000 | 100,020 |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第67回 | 0.001 | 100,000 | 100,000 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第53回 | 1.38 | 400,000 | 400,478 |
| 国際協力銀行債券 第16回財投機関債 | 2.07 | 100,000 | 100,172 |
| 小 計 | | 700,000 | 700,671 |
| 金融債券 | | | |
| 商工債券 利付第771回い号 | 0.2 | 350,000 | 350,021 |
| 小 計 | | 350,000 | 350,021 |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | | |
| 中部電力 第492回 | 1.405 | 350,000 | 350,881 |
| 東北電力 第452回 | 1.405 | 100,000 | 100,489 |
| 九州電力 第423回 | 0.959 | 100,000 | 100,093 |
| 北海道電力 第319回 | 0.514 | 550,000 | 550,281 |
| 三菱東京UFJ銀行 第110回特定社債間限定同順位特約付 | 1.485 | 400,000 | 400,898 |
| 三菱UFJリース 第26回社債間限定同順位特約付 | 0.441 | 200,000 | 200,224 |
| 三井不動産 第37回社債間限定同順位特約付 | 1.493 | 100,000 | 100,484 |
| 東京急行電鉄 第69回社債間限定同順位特約付 | 1.7 | 200,000 | 200,594 |
| 東海旅客鉄道 第16回社債間限定同順位特約付 | 1.875 | 600,000 | 600,959 |
| 電源開発 第28回社債間限定同順位特約付 | 1.474 | 200,000 | 200,017 |
| 小 計 | | 2,800,000 | 2,804,925 |
| 合 計 | | 5,006,000 | 5,013,521 |

*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 499,996 | % 5.9 |

*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

(2019年8月19日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 5,013,521 | 59.3 |
| その他有価証券 | 499,996 | 5.9 |
| コール・ローン等、その他 | 2,944,648 | 34.8 |
| 投資信託財産総額 | 8,458,165 | 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 (2019年8月19日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 8,458,165,584 |
| コール・ローン等 | 2,925,096,627 |
| 公社債(評価額) | 5,013,521,293 |
| その他有価証券 | 499,996,087 |
| 未収利息 | 7,780,208 |
| 前払費用 | 11,771,369 |
| (B) 負債 | 4,506 |
| 未払利息 | 4,506 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 8,458,161,078 |
| 元本 | 8,288,568,727 |
| 次期繰越損益金 | 169,592,351 |
| (D) 受益権総口数 | 8,288,568,727口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,205円 |

(注) 期首元本額は13,238,234,160円、期中追加設定元本額は505,769,218円、期中一部解約元本額は5,455,434,651円、1口当たり純資産額は1.0205円です。

○損益の状況 (2018年8月21日～2019年8月19日)

| 項 目 | 当 期 |
|----------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 46,233,836 |
| 受取利息 | 48,231,124 |
| 支払利息 | △ 1,997,288 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 48,206,310 |
| 売買損 | △ 48,206,310 |
| (C) 当期損益金(A+B) | △ 1,972,474 |
| (D) 前期繰越損益金 | 273,342,594 |
| (E) 追加信託差損益金 | 10,418,721 |
| (F) 解約差損益金 | △112,196,490 |
| (G) 計(C+D+E+F) | 169,592,351 |
| 次期繰越損益金(G) | 169,592,351 |

*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(E)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(F)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30(非課税適格機関投資家専用) | 5,129,840,665 |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家転売制限付) | 2,050,866,611 |
| 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) | 424,221,200 |
| 野村世界高金利通貨投信 | 151,953,753 |
| 野村日本ブランド株投資(マネープールファンド)年2回決算型 | 104,556,769 |
| ノムラ・アジア・シリーズ(マネープール・ファンド) | 96,909,215 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 85,180,134 |
| 野村高金利国際機関債投信(毎月分配型) | 49,354,623 |
| ネクストコア | 19,922,154 |

| ファンド名 | 当期末 |
|---------------------------------------|------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 野村世界業種別投資シリーズ(マネープール・ファンド) | 10,607,461 |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド) | 7,492,405 |
| 第12回 野村短期公社債ファンド | 6,664,982 |
| 第9回 野村短期公社債ファンド | 5,094,831 |
| 第2回 野村短期公社債ファンド | 3,919,169 |
| 第1回 野村短期公社債ファンド | 3,037,421 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(マネープールファンド)年2回決算型 | 2,551,759 |
| 野村新エマージング債券投信(マネープールファンド)年2回決算型 | 2,513,115 |
| 第5回 野村短期公社債ファンド | 1,959,729 |

| ファンド名 | 当期末 |
|---------------------------------------|-----------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 第10回 野村短期公社債ファンド | 1,959,728 |
| 第11回 野村短期公社債ファンド | 1,861,757 |
| 第3回 野村短期公社債ファンド | 1,371,897 |
| 野村グローバル・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 | 1,230,043 |
| 第4回 野村短期公社債ファンド | 1,077,981 |
| 第6回 野村短期公社債ファンド | 1,077,981 |
| 野村グローバルCB投信(マネーボールファンド)年2回決算型 | 996,807 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型 | 984,834 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型 | 984,834 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型 | 984,834 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型 | 984,834 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(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・イールド債券投信(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 |
| 野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)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 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型 | 982,898 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型 | 982,898 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型 | 982,898 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型 | 982,898 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア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 |
| 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 |

| ファンド名 | 当期末 |
|-------------------------------------|---------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(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信 | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型 | 982,608 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(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(豪ドルコース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村日本ブランド株投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型 | 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(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・イールド債券投信(円コース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(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・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(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信(円コース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村新エマージング債券投信(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信(インドネシアルピアコース)毎月分配型 | 982,608 |
| 野村新エマージング債券投信(円コース)年2回決算型 | 982,608 |
| 野村新エマージング債券投信(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信(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PMCO新興国インフラ関連債券投信(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(円コース)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信(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信(中国元コース)毎月分配型 | 982,607 |
| 野村PMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)毎月分配型 | 982,607 |
| 野村PMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型 | 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 |
| 野村カルミニャック・ファンド Aコース | 981,547 |
| 野村カルミニャック・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(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(米ドルコース)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 |
| 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 |
| 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 |

| ファンド名 | 当期末 |
|---------------------------------------|---------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 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(ブラジルレアルコース) 毎月分配型 | 946,340 |
| 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 | 774,485 |
| 第7回 野村短期公社債ファンド | 686,093 |
| 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(豪ドルコース) 毎月分配型 | 315,476 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース) 毎月分配型 | 277,875 |
| 野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース) 年2回決算型 | 253,829 |
| 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 | 213,673 |
| 野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース) 毎月分配型 | 123,377 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース) 年2回決算型 | 118,445 |
| 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 |
| 野村新米国ハイ・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 | 98,261 |
| 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(A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8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 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース) 年2回決算型 | 98,260 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース) 年2回決算型 | 98,260 |
| 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 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 |

| ファンド名 | 当期末 |
|--|--------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース) 毎月分配型 | 54,497 |
| 野村通貨選択日本株投信(中国元コース) 年2回決算型 | 51,703 |
| 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(トルコリラコース) 年2回決算型 | 43,905 |
| 野村通貨選択日本株投信(中国元コース) 毎月分配型 | 41,316 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース) 年2回決算型 | 36,381 |
| 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 |
| 野村新米国ハイ・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 | 9,805 |
| 野村新米国ハイ・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 | 9,805 |
| 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 ブラジルレアル毎月分配型 | 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PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり) 毎月分配型 | 9,797 |
| 野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり) 年2回決算型 | 9,797 |
| 野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Aコース | 9,797 |
| 野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Bコース | 9,797 |
| 野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Cコース | 9,797 |
| 野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Dコース | 9,797 |
| 野村ファンドラップ債券プレミア | 9,795 |
| 野村ファンドラップオルタナティブプレミア | 9,795 |
| 野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け) | 9,794 |
| 野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け) | 9,794 |
| 野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け) | 9,794 |
| 野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け) | 9,794 |
| 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 |
| 野村通貨選択日本株投信(ユーロコース) 毎月分配型 | 1,813 |

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。

(2019年9月17日現在)

| ファンド名 年 月 | 「円コース」 「資源国通貨コース」 | 「アジア通貨コース」 |
|--------------|----------------------|-------------|
| 2019年9月 | — | — |
| 10月 | — | 1、2、3、4、7、8 |
| 11月 | 1、11、28 | 1、11、28 |
| 12月 | 24、25、26 | 24、25、26 |

※2019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注意ください。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。