

野村グローバルボンド投信 Aコース

運用報告書(全体版)

第8期(決算日2018年8月6日)

作成対象期間(2018年2月7日～2018年8月6日)

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/資産複合	
信託期間	2014年8月11日から2024年8月6日までです。	
運用方針	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・ファンドーグローバル・ボンドーJPY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、高利回り事業債(ハイ・イールド債)を含む世界の債券および米ドル建ての企業向け貸付債権(バンクローン)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中長期的な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・ファンドーグローバル・ボンドーJPY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します。	
主な投資対象	野村グローバルボンド投信 Aコース	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ボンドーJPYクラス受益証券および野村マネー マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。
	ノムラ・マルチ・ マネージャーズ・ファンドー グローバル・ボンドー JPYクラス	高利回り事業債(ハイ・イールド債)を含む世界の債券および米ドル建ての企業向け貸付債権(バンクローン)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	野村グローバルボンド投信 Aコース	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(評価益を含みます。)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 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
		税 込 分 配 金	騰 落 率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
4期(2016年8月8日)	9,929	0	6.8	0.0	—	98.9	913
5期(2017年2月6日)	10,182	10	2.6	0.0	—	98.5	1,037
6期(2017年8月7日)	10,280	10	1.1	0.0	—	98.8	1,074
7期(2018年2月6日)	10,231	10	△0.4	0.0	—	99.1	800
8期(2018年8月6日)	10,156	10	△0.6	0.0	—	99.1	520

*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 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
		騰 落 率	率			
(期首)	円	%	%	%	%	%
2018年2月6日	10,231	—	0.0	—	99.1	
2月末	10,196	△0.3	0.0	—	98.3	
3月末	10,122	△1.1	0.0	—	98.7	
4月末	10,126	△1.0	0.0	—	98.7	
5月末	10,089	△1.4	0.0	—	98.7	
6月末	10,089	△1.4	0.0	—	98.7	
7月末	10,158	△0.7	0.0	—	98.7	
(期末)						
2018年8月6日	10,166	△0.6	0.0	—	99.1	

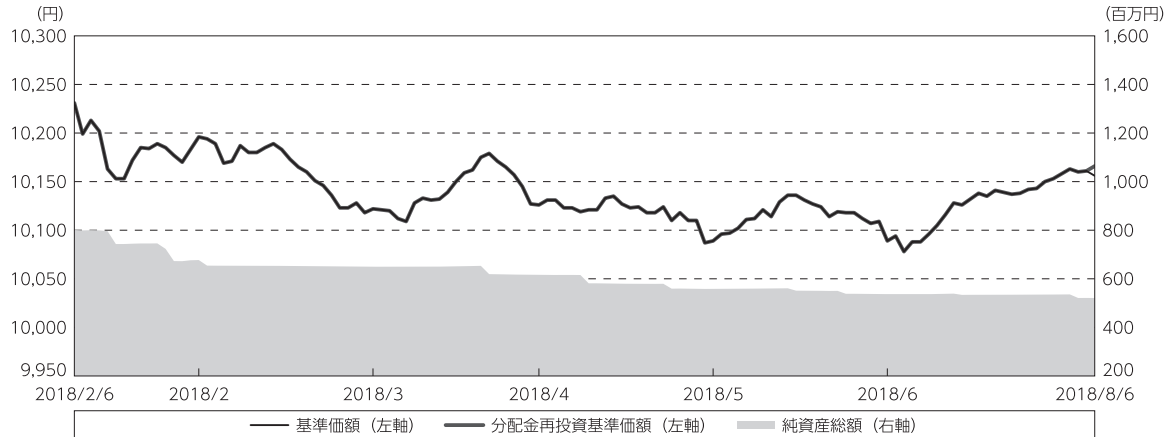
*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

*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：10,231円

期末：10,156円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率：△ 0.6%（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（2018年2月6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、当作成期首10,231円から当作成期末には10,156円となりました。

- ・ 実質的に投資している、高利回り事業債（ハイ・イールド債）を含む世界の債券※および米ドル建ての企業向け貸付債権（バンクローン）からのインカムゲイン（利子収入）
- ・ 実質的に投資している、高利回り事業債（ハイ・イールド債）を含む世界の債券および米ドル建ての企業向け貸付債権（バンクローン）からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）
- ・ 円／投資対象資産にかかる通貨の為替変動

※国債、政府機関債、国際機関債、社債など。ハイ・イールド債のほか、新興国の政府、政府機関もしくは企業の発行する債券（現地通貨建てを含みます。）等を含みます。

○投資環境

<ハイ・イールド債券市場>

FRB（米連邦準備制度理事会）による利上げ加速や米朝首脳会談、米中貿易摩擦などに対する市場の警戒感に左右され、6月下旬までは一進一退の値動きとなりました。その後、6月の米雇用統計が市場予想を上回るなど好調な経済指標が発表されたことや、トランプ米大統領とユンケル欧州委員長が米欧間の貿易障壁縮小の方針で合意したことなどから上昇し、当作成期間では値上がりとなりました。

<バンクローン市場>

概ね堅調な米国経済指標が発表されたことや、ローンの需要が供給に対して相対的に高かったことなどから上昇し、当作成期間で値上がりとなりました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村グローバルボンド投信 Aコース（米ドル売り円買い 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・ボンドーJPY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・ボンドーJPY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・ボンドーJPY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・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、当作成期末現在で、AAA格6.1%、AA格7.5%、A格3.3%、BBB格4.5%、BB格21.1%、B格35.4%、CCC格以下および無格付14.3%となりました。

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

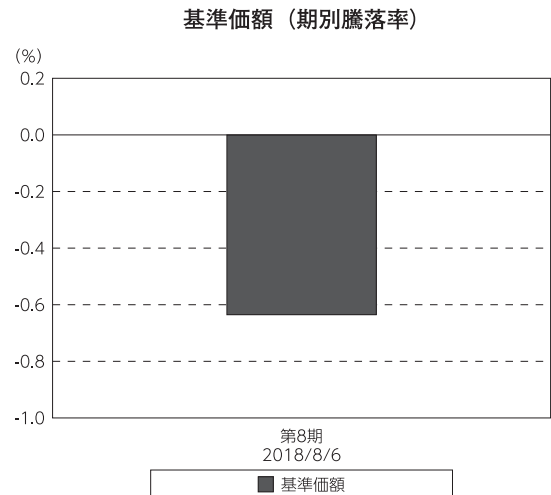
[野村マネー マザーファンド]

残存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、1万円当たり・税込み)

項 目	第8期
	2018年2月7日～ 2018年8月6日
当期分配金 (対基準価額比率)	10 0.098%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,879

(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

【野村グローバルボンド投信 Aコース（米ドル売り円買い 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・ボンドーJPY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。通常の場合においては、「ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ボンドーJPYクラス」への投資を中心としますが、投資比率には特に制限は設けず、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するものの、その投資比率は、概ね90%以上を目処とします。

【ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ボンドーJPYクラス】

高利回り事業債（ハイ・イールド債）を含む世界の債券および米ドル建ての企業向け貸付債権（バンクローン）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中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。

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注意ください。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしく願いいたします。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

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

○1万口当たりの費用明細

(2018年2月7日～2018年8月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 54	% 0.536	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(9)	(0.091)	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)	(43)	(0.428)	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)	(0.016)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.001	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	54	0.537	
期中の平均基準価額は、10,130円です。			

- * 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
 * 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
 * その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
 * 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。
 * 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2018年2月7日～2018年8月6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-グローバル・ボンド-Ⅱクラス	口 —	千円 —	口 30,802	千円 262,530

- * 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

(2018年2月7日～2018年8月6日)

利害関係人との取引状況

<野村グローバルボンド投信 Aコース>

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 8,818	百万円 401	% 4.5	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

(2018年8月6日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド-グローバル・ボンド-JPYクラス	口	口	千円	%
	91,876	61,074	516,258	99.1
合 計	91,876	61,074	516,258	99.1

*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	評 価 額
野村マネー マザーファンド	千口	千口	千円	千円
	98	98	98	100

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2018年8月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 516,258	% 95.7
野村マネー マザーファンド	100	0.0
コール・ローン等、その他	22,886	4.3
投資信託財産総額	539,244	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 (2018年8月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	539,244,246
コール・ローン等	10,101,060
投資信託受益証券(評価額)	516,258,522
野村マネー マザーファンド(評価額)	100,068
未収入金	12,784,596
(B) 負債	18,301,599
未払収益分配金	512,929
未払解約金	14,517,457
未払信託報酬	3,264,724
未払利息	20
その他未払費用	6,469
(C) 純資産総額(A-B)	520,942,647
元本	512,929,720
次期繰越損益金	8,012,927
(D) 受益権総口数	512,929,720口
1万円当たり基準価額(C/D)	10,156円

(注) 期首元本額は782,844,393円、期中追加設定元本額は4,254,455円、期中一部解約元本額は274,169,128円、1口当たり純資産額は1.0156円です。

○損益の状況 (2018年2月7日～2018年8月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	11,348,318
受取配当金	11,351,312
支払利息	△ 2,994
(B) 有価証券売買損益	△11,997,102
売買益	2,589,693
売買損	△14,586,795
(C) 信託報酬等	△ 3,271,193
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 3,919,977
(E) 前期繰越損益金	15,239,186
(F) 追加信託差損益金	△ 2,793,353
(配当等相当額)	(48,345,408)
(売買損益相当額)	(△51,138,761)
(G) 計(D+E+F)	8,525,856
(H) 収益分配金	△ 512,929
次期繰越損益金(G+H)	8,012,927
追加信託差損益金	△ 2,793,353
(配当等相当額)	(48,345,408)
(売買損益相当額)	(△51,138,761)
分配準備積立金	48,080,544
繰越損益金	△37,274,264

*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 (2018年2月7日～2018年8月6日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2018年2月7日～ 2018年8月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	8,077,277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	48,345,408円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	40,516,196円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	96,938,881円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	1,889円
g. 分配金	512,929円
h. 分配金(1万円当たり)	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

(2018年8月6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(13,953,356千円)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		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
地方債証券	370,000 (370,000)	370,633 (370,633)	2.6 (2.6)	— (—)	— (—)	— (—)	2.6 (2.6)
特殊債券 (除く金融債)	1,630,000 (1,630,000)	1,632,958 (1,632,958)	11.5 (11.5)	— (—)	— (—)	— (—)	11.5 (11.5)
金融債券	1,750,000 (1,750,000)	1,751,510 (1,751,510)	12.3 (12.3)	— (—)	— (—)	— (—)	12.3 (12.3)
普通社債券 (含む投資法人債券)	1,500,000 (1,500,000)	1,506,507 (1,506,507)	10.6 (10.6)	— (—)	— (—)	— (—)	10.6 (10.6)
合 計	5,250,000 (5,250,000)	5,261,609 (5,261,609)	36.9 (36.9)	— (—)	— (—)	— (—)	36.9 (36.9)

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

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

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	利 率	当 期		評 価 額	償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額		
地方債証券	%	千円	千円		
神奈川県 公募第158回	1.53	30,000	30,167	2018/12/20	
大阪府 公募(5年)第100回	0.244	300,000	300,236	2018/11/28	
横浜市 公募公債平成20年度5回	1.58	40,000	40,228	2018/12/20	
小 計		370,000	370,633		
特殊債券(除く金融債)					
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第44回	1.62	130,000	130,776	2018/12/20	
地方公共団体金融機構債券 F39回	0.808	100,000	100,055	2018/8/28	
日本政策金融公庫社債 第55回財投機関債	0.001	400,000	400,004	2018/8/9	
中日本高速道路債券 財投機関債第5回	1.86	1,000,000	1,002,122	2018/9/20	
小 計		1,630,000	1,632,958		
金融債券					
農林債券 利付第762回い号	0.3	700,000	700,640	2018/11/27	
しんきん中金債券 利付第287回	0.3	450,000	450,314	2018/10/26	
しんきん中金債券 利付第288回	0.3	600,000	600,555	2018/11/27	
小 計		1,750,000	1,751,510		
普通社債券(含む投資法人債券)					
関西電力 第469回	1.7	300,000	301,107	2018/10/25	
トヨタ自動車 第8回社債間限定同等特約付	2.01	100,000	100,740	2018/12/20	
みずほ銀行 第35回特定社債間限定同順位特約付	0.285	200,000	200,265	2019/1/25	
住友不動産 第91回社債間限定同順位特約付	0.355	100,000	100,078	2018/10/29	
N T T ドコモ 第17回社債間限定同順位特約付	1.77	200,000	200,438	2018/9/20	
N T T データ 第22回社債間限定同順位特約付	1.78	600,000	603,876	2018/12/20	
小 計		1,500,000	1,506,507		
合 計		5,250,000	5,261,609		

* 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	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 3,399,994	% 23.9

* 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 Bond

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ボンド

2017年12月31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	
主要投資対象	◆高利回り事業債(ハイ・イールド債)を含む世界の債券および米ドル建ての企業向け貸付債権(バンクローン)	
投資方針	●ハイ・イールド債 ^{*1} を含む世界の債券および米ドル建てのバンクローン ^{*2} を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。 ※1 ハイ・イールド債とは、S&P社による格付がBB+以下、あるいはムーディーズ・インベスターズ社による格付がBa1以下の債券(格付のない場合は同等の信用度を有すると判断されるものを含みます。)をいいます。 ※2 バンクローンとは、事業会社等が事業の拡大等に必要資金を調達するために、銀行等の金融機関等から借入れるローンをいいます。 ●投資にあたっては、3つの投資戦略(「ハイ・イールド債戦略」、「バンクローン戦略」、「ストラテジック・インカム/トータル・リターン戦略」)に配分します。なお、1投資戦略あたりの配分比率は、原則として、純資産総額の25%以上50%以内に維持することを基本とします。	
	投資戦略	主な投資方針
	ハイ・イールド債戦略	世界のハイ・イールド債を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。
	バンクローン戦略	米ドル建てのバンクローンを主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。
	ストラテジック・インカム/トータル・リターン戦略	ハイ・イールド債を含む世界の債券を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインとキャピタルゲインの獲得によるトータル・リターンの追求を目指します。
投資方針	●バンクローンへの投資にあたっては、主として、変動金利型で、債券等に比べ弁済順位が高く、取得時においてS&P社による格付がBB+以下、あるいはムーディーズ・インベスターズ社による格付がBa1以下のもの(格付のない場合は同等の信用度を有すると判断されるものを含みます。)に投資を行います。 ●JPYクラスについては、実質的な通貨配分にかかわらず、原則として純資産総額を米ドル換算した額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行います。 ●USDクラスについては、対円の為替ヘッジを行いません。 ●CRSクラスについては、実質的な通貨配分にかかわらず、原則として純資産総額を米ドル換算した額とほぼ同額程度の米ドルを売り、米ドル以外の選定通貨を買う為替取引を行います。 ●投資顧問会社が、世界の債券および米ドル建てのバンクローン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、各投資戦略の運用において優れていると判断した運用会社を選定します。 ●投資顧問会社は選定した副投資顧問会社およ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人替を適宜行います。 <CRSクラスにおける通貨運用方針> ●原則として、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ブロードおよびJP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・ブロード構成国の通貨の中から、金利水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、相対的に金利が高い5つの通貨を選定することを基本とします。選定通貨は定期的に(原則、毎月)見直すこととします。 ●1通貨当りのエクスポージャーについては、原則として、純資産総額の10%~30%程度の範囲内に維持することを基本とします。 ●ファンダメンタルズおよび流動性を考慮して、選択される通貨が4以下または6以上となる場合があります。この場合、1通貨当りのエクスポージャーは上記の範囲を超える場合があります。	
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	
通貨運用会社	ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド	
管理事務代行会社 保管銀行	ノムラ・バンク(ルクセンブルグ)エス・エー	

◇作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに作成いたしました。

◇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・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(「カストディ・ルール」)に基づき、保管銀行から受益者または受益者のために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
2017年12月31日現在
(金額は米ドル表示)

資産		
投資有価証券時価		165,223,831
(取得原価: 169,463,275 米ドル)		
投資オプション評価金額(買い)		4,650
(取得原価: 1,664 米ドル)		
現金預金等		13,855,954
先物契約に係る評価差益		69,667
外国為替先渡し契約に係る評価差益		1,739,412
デリバティブ取引に係る委託証拠金		486,794
未収収益		1,709,621
現金および現金等価物に係る利息		382
ブローカーからの未収金		740,175
受益証券発行未収金		196,454
		184,026,940
資産合計		184,026,940
負債		
銀行借越金		854,229
金利スワップ契約に係る評価差損		154,166
クレジット・デフォルト・スワップ契約に係る評価差損		212,404
金利スワップ契約に係る未払利息		226
ブローカーへの未払金		4,355,421
受益証券買戻支払金		1,283,217
未払費用		488,481
		7,348,144
負債合計		7,348,144
純資産総額		176,678,796

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)	8,643	156,026	1,348,468,241
通貨セレクトクラス(円)	5,352	1,597,998	8,552,000,809
米ドルクラス(円)	10,054	993,592	9,990,044,680

運用計算書

2017年12月31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	138,224
債券利息	10,521,949
金利スワップ契約に係る受取利息	5,992
受取配当金等	266,741
雑収益	420
収益合計	10,933,326
費用	
投資顧問報酬	1,867,974
事務管理代行報酬	233,893
保管費用	70,499
源泉徴収税	471
金利スワップ契約に係る支払利息	3,711
当座借越利息	13,792
取引銀行報酬	130,126
銀行手数料	560,460
受託報酬	46,817
法務報酬	1,312
立替費用	23,381
専門家報酬	75,759
設立費用償却	7,100
雑費用	1,628
費用合計	3,036,923
純投資損益	7,896,403
投資有価証券売買に係る損益	527,954
先物契約に係る損益	(1,113,713)
オプション契約に係る損益	5,675
外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益	12,040,632
金利スワップ契約に係る損益	(198,530)
クレジット・デフォルト・スワップ契約に係る損益	(212,423)
当期実現純損益	11,049,595
投資有価証券評価損益の増減	2,616,257
先物契約に係る評価損益の増減	167,299
オプション契約に係る評価損益の増減	2,986
外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減	(2,301,787)
金利スワップ契約に係る評価損益の増減	52,486
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	(101,005)
当期評価差損益	436,236
運用の結果による純資産の増減額	19,382,234

純資産変動計算書
2017年12月31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	268,784,207
純投資損益	7,896,403
当期実現純損益	11,049,595
当期評価差損益	436,236
運用の結果による純資産の増減額	19,382,234
受益証券の発行手取金	8,987,482
受益証券の買戻支払金	(104,431,448)
	(95,443,966)
受益者への支払分配金	(16,043,679)
期末純資産総額	176,678,796

発行済受益証券数の変動表
2017年12月31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	172,422
発行受益証券数	52,384
買戻受益証券数	(68,780)
期末現在発行済受益証券数	<u>156,026</u>
通貨セレクトクラス	
期首受益証券数	2,435,905
発行受益証券数	97,715
買戻受益証券数	(935,622)
期末現在発行済受益証券数	<u>1,597,998</u>
米ドルクラス	
期首受益証券数	1,593,702
発行受益証券数	1,941
買戻受益証券数	(602,051)
期末現在発行済受益証券数	<u>993,592</u>

統計情報
2017年12月31日現在
(未監査)

	2017	2016	2015
期末純資産総額(米ドル)	176,678,796	268,784,207	340,279,090
日本円クラス(円)			
期末純資産総額	1,348,468,241	1,526,279,706	1,294,344,326
期末1口当たり純資産価格	8,643	8,852	8,715
通貨セレクトクラス(円)			
期末純資産総額	8,552,000,809	13,284,086,794	15,977,090,312
期末1口当たり純資産価格	5,352	5,453	6,689
米ドルクラス(円)			
期末純資産総額	9,990,044,680	16,661,593,227	23,711,779,645
期末1口当たり純資産価格	10,054	10,455	10,484

組入資産明細
2017年12月31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(%)
アルゼンチン					
国債					
EUR	170,000	ARGENTINA 3.3750% 15/01/23	196,945	207,394	0.12
USD	180,000	ARGENTINA 7.1250% 28/06/2117	162,000	185,490	0.10
		合計: アルゼンチン	358,945	392,884	0.22
			358,945	392,884	0.22
オーストラリア					
変動金利債					
USD	95,000	WESTPAC BK NZ FRN 21/03/66	95,000	94,707	0.05
			95,000	94,707	0.05
普通社債(固定金利債)					
USD	200,000	TELSTRA CORP L 3.2500% 15/11/27 DIP	199,356	197,862	0.12
		合計: オーストラリア	199,356	197,862	0.12
			294,356	292,569	0.17
パハマ					
普通社債(固定金利債)					
USD	25,000	SILVERSEA CRUISE 7.25% 01/02/25 144	25,000	26,938	0.02
		合計: パハマ	25,000	26,938	0.02
			25,000	26,938	0.02
バミューダ諸島					
普通社債(固定金利債)					
USD	129,000	VIK CRUISES L 5.8750% 15/09/27 144A	129,435	131,257	0.07
USD	112,000	VIKING CRUISES LTD 6.25% 15/5/25 14	112,000	115,360	0.07
USD	69,000	NCL CORP 4.75% 15/12/21 144A	69,348	71,415	0.04
USD	50,000	AIRCASTLE LTD 5.125% 15/03/21	51,063	52,563	0.03
USD	39,000	WEATHERFORD BERMUDA 6.75% 15/09/40	28,977	31,980	0.02
USD	25,000	WEATHERFORD BERMUDA 6.5% 01/08/36	20,375	20,563	0.01
		合計: バミューダ諸島	411,198	423,138	0.24
			411,198	423,138	0.24
英領ヴァージン諸島					
普通社債(固定金利債)					
USD	450,000	SINOPEC GRP OVERS 3.90% 17/5/22 REG	458,723	465,162	0.26
		合計: 英領ヴァージン諸島	458,723	465,162	0.26
			458,723	465,162	0.26
カナダ					
国債					
CAD	650,000	CANADA-GOV'T 1.0000% 01/06/27	475,225	471,083	0.27
			475,225	471,083	0.27
普通社債(固定金利債)					
USD	215,000	VPII ESCROW CORP 7.5% 15/07/21 144A	222,081	218,762	0.13
USD	138,000	BROOKFIELD RESID 6.375% 15/5/25 144	138,020	146,279	0.09

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	128,000	TECK RESOURCES LTD 6% 15/08/40	106,011	142,399	0.09
USD	143,000	VRX ESCROW 5.875% 15/05/23 144A	138,613	132,632	0.09
USD	135,000	BOMBARDIER INC 6.125% 15/01/23 144A	129,027	132,299	0.07
USD	109,000	NORBORD INC 6.25% 15/04/23 144A	109,750	118,945	0.07
USD	108,000	NOVA CHEMICALS CORP 5.25% 01/06/27	108,162	107,730	0.06
USD	100,000	TECK RESOURCES LTD 4.75% 15/01/22	88,135	104,380	0.06
USD	78,000	GW HONOS SEC 8.75% 15/05/25 144A	78,430	83,265	0.05
USD	78,000	NEW GOLD INC 6.375% 15/05/25 144A	79,019	82,680	0.05
USD	79,000	NORTHWEST/DOM 7.1250% 01/11/22 144A	80,014	81,568	0.05
USD	75,000	OPEN TEXT CORP 5.875% 01/06/26 144A	75,156	80,813	0.05
USD	75,000	CASCADES INC 5.75% 15/07/23 144A	75,000	77,438	0.04
USD	75,000	TASEKO MINES 8.7500% 15/06/22 144A	74,250	76,781	0.04
USD	50,000	BOMBARDIER INC 8.75% 01/12/21 144A	56,125	54,875	0.03
USD	50,000	PARAMOUNT RES 6.875% 30/06/23 144A	50,563	53,125	0.03
USD	50,000	VALEANT PHARM 9.0000% 15/12/25 144A	50,219	52,110	0.03
USD	50,000	BOMBARDIER IN 7.5000% 01/12/24 144A	50,000	50,750	0.03
USD	50,000	1011778 BC UL 5.0000% 15/10/25 144A	50,156	50,375	0.03
USD	50,000	BOMBARDIER INC 6% 15/10/22 144A	43,125	49,125	0.03
USD	49,000	NOVA CHEMICALS CORP 4.875% 01/06/24	49,000	48,878	0.03
USD	50,000	VRX ESCROW 6.125% 15/4/25 144A	42,302	45,750	0.03
USD	50,000	MEG ENERGY CORP 6.375% 30/1/23 144A	45,500	42,500	0.02
USD	36,000	NEW GOLD INC 6.25% 15/11/22 144A	37,140	37,170	0.02
USD	25,000	LG FINANCECO 5.875% 01/11/24 144A	25,000	26,406	0.01
USD	27,000	VALEANT PHARMA 5.625% 01/12/21 144A	21,229	26,393	0.01
USD	25,000	KINROSS GOLD CORP 5.125% 01/09/21	25,875	26,063	0.01
USD	25,000	TECK RESOURCES LTD 4.5% 15/01/21	26,000	25,780	0.01
USD	25,000	GARDA WORLD SEC 7.25% 15/11/21 144A	22,188	25,563	0.01
USD	25,000	PRECISION DRI 7.1250% 15/01/26 144A	25,000	25,500	0.01
USD	25,000	KISSNER GR HDG 8.375% 01/12/22 144A	25,000	25,250	0.01
USD	25,000	TECK RESOURCES LTD 3.75% 01/02/23	24,375	25,063	0.01
USD	25,000	MOUNTAIN PROV 8.0000% 15/12/22 144A	24,498	24,719	0.01
USD	25,000	MEG ENERGY CORP 6.5% 15/01/25 144A	24,438	24,688	0.01
USD	25,000	TRINIDAD DRIL 6.625% 15/02/25 144A	25,000	23,750	0.01
USD	25,000	PRECISION DRILLING 5.25% 15/11/24	20,000	23,563	0.01
USD	18,000	VALEANT PHARMA 6.5% 15/03/22 144A	18,000	18,900	0.01
USD	17,000	VALEANT PHARM 5.5000% 01/11/25 144A	17,000	17,298	0.01
USD	25,000	CONCORDIA HLTH COR 7% 15/04/23 144A	10,438	2,281	0.00
USD	200,000	SANJEL CORP 7.5% 19/06/19	153,000	20	0.00
			2,462,839	2,411,866	1.36
		合計: カナダ	2,938,064	2,882,949	1.63
		ケイマン諸島			
資産担保証券					
USD	500,000	OCP 2015-9A AIR FRN 15/07/27	500,000	500,249	0.28
USD	250,000	BLUEM 2014-2A AR FRN 20/07/26	250,000	250,687	0.14
USD	250,000	CTWTR 2014-1A A1AR FRN 15/07/26	250,000	250,562	0.14
USD	250,000	OCT24 2015-1A A1R FRN 21/05/27	250,000	250,171	0.14
USD	250,000	VOYA 2014-4A A1R FRN 14/10/26	250,000	249,967	0.14
			1,500,000	1,501,636	0.84
ステップアップ/ダウン債					
USD	75,000	TRANSOCEAN INC STUP 3.8% 15/10/22	64,552	73,875	0.05
USD	25,000	TRANSOCEAN INC 7.35% 15/12/41	23,938	24,188	0.01
			88,490	98,063	0.06
普通社債(固定金利債)					
USD	450,000	MIZUHO FIN GP CAY 4.2% 18/7/22 REGS	471,449	462,340	0.27
USD	400,000	UPCB FINANCE IV 5.375% 15/1/25 144A	390,500	402,000	0.23
USD	90,000	SEAGATE HDD CAY 4.75% 01/06/23	82,463	91,350	0.05

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	PARK AEROSPACE HDG 5.25% 15/08/22 1	50,000	49,688	0.03
USD	71,000	NOBLE HDGS INTL 6.05% 01/03/41	41,635	48,635	0.03
USD	50,000	NOBLE HDGS INTL 7.75% 15/01/24	49,005	43,000	0.02
USD	43,000	SEAGATE HDD CAY 4.75% 01/01/25	33,003	42,206	0.02
USD	35,000	VALE OVERSEAS LTD 6.25% 10/08/26	38,519	40,548	0.02
USD	32,000	SEAGATE HDD CAY 4.25% 01/03/22 144A	31,926	32,377	0.02
USD	34,000	NOBLE HDGS INTL 6.95% 01/04/45	23,402	26,945	0.02
USD	25,000	TRANSOCEAN IN 7.5000% 15/01/26 144A	26,063	25,601	0.01
			1,237,965	1,264,690	0.72
		合計: ケイマン諸島	2,826,455	2,864,389	1.62
		ドミニカ共和国			
国債					
USD	100,000	DOMINICAN REP 7.45% 30/04/44 144A	111,440	119,250	0.07
			111,440	119,250	0.07
その他債券					
USD	100,000	DOMINICAN REP 5.875% 18/04/24 REGS	103,100	108,375	0.06
			103,100	108,375	0.06
		合計: ドミニカ共和国	214,540	227,625	0.13
		エクアドル			
国債					
USD	200,000	REP OF ECUADOR 9.65% 13/12/26 REGS	200,440	229,500	0.13
			200,440	229,500	0.13
		合計: エクアドル	200,440	229,500	0.13
		フィンランド			
普通社債(固定金利債)					
USD	35,000	NOKIA OYJ 3.3750% 12/06/22	34,825	34,783	0.02
			34,825	34,783	0.02
		合計: フィンランド	34,825	34,783	0.02
		フランス			
変動金利債					
EUR	200,000	SCOR SE FRN 27/05/48	223,520	270,928	0.16
EUR	200,000	TOTAL SA 2.625% 29/12/49 emtn	231,595	251,786	0.14
USD	200,000	BNP PARIBAS FRN 29/12/49 144A	200,000	216,500	0.12
			655,115	739,214	0.42
普通社債(固定金利債)					
EUR	400,000	BANQUE FED CRED 2.625% 18/03/24 EMT	553,530	535,644	0.30
USD	400,000	BNP PARIBAS 4.25% 15/10/24	400,833	422,062	0.24
USD	300,000	EDF 6.95% 26/01/39	402,900	408,441	0.23
EUR	300,000	BNP PARIBAS 2.375% 20/05/24 EMTN	406,397	397,604	0.23
USD	207,000	NUMERICABLE SFR 7.375% 01/05/26 144	207,000	212,434	0.12
USD	200,000	NUMERICABLE GRP 6% 15/05/22 144A	205,063	202,600	0.11
			2,175,723	2,178,785	1.23
		合計: フランス	2,830,838	2,917,999	1.65
		ドイツ			
変動金利債					
EUR	400,000	ALLIANZ SE FRN 29/09/49	502,414	530,856	0.30
			502,414	530,856	0.30

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	200,000	UNITYMEDIA KABEL 6.125% 15/01/25 14	200,625	211,000	0.12
		合計: ドイツ	200,625	211,000	0.12
			703,039	741,856	0.42
インドネシア					
国債					
EUR	150,000	REP OF INDONESIA 2.625% 14/6/23 REG	168,781	193,865	0.11
		合計: インドネシア	168,781	193,865	0.11
			168,781	193,865	0.11
アイルランド					
国債					
EUR	1,250,000	IRISH GVT 2.4% 15/05/30	1,524,401	1,721,065	0.98
			1,524,401	1,721,065	0.98
普通社債(固定金利債)					
USD	240,000	ARDAGH PKG FIN 6% 15/02/25 144A	243,600	252,600	0.14
		合計: アイルランド	243,600	252,600	0.14
			1,768,001	1,973,665	1.12
イタリア					
普通社債(固定金利債)					
USD	100,000	WIND TRE SPA 5.0000% 20/01/26	100,000	94,050	0.05
		合計: イタリア	100,000	94,050	0.05
			100,000	94,050	0.05
日本					
国債					
JPY	57,000,000	JAPAN GVT 10YR 0.1% 10/03/25 CPI 20	583,746	539,141	0.31
			583,746	539,141	0.31
短期国庫債券					
JPY	484,000,000	JAPAN T-BILL 0% 13/02/18 700	4,377,283	4,299,593	2.43
		合計: 日本	4,377,283	4,299,593	2.43
			4,961,029	4,838,734	2.74
ルクセンブルグ					
普通社債(固定金利債)					
USD	1,575,000	INTELSAT LUX 8.125% 01/06/23	1,675,574	816,203	0.46
USD	187,000	INTELSAT JACKSON 7.5% 01/04/21	169,977	170,169	0.10
USD	210,000	MALLINCKRODT INTL 4.75% 15/04/23	196,203	166,425	0.09
USD	156,000	DANA FIN LUX SARL 5.75% 15/4/25 144	158,327	164,385	0.09
USD	150,000	INTELSAT JACK 9.7500% 15/07/25 144A	151,500	144,375	0.08
USD	125,000	CAMELOT FINANCE 7.875% 15/10/24 144	125,469	133,438	0.08
USD	50,000	TELECOM ITALIA CAP 7.721% 04/06/38	55,625	64,500	0.04
USD	49,000	MALLINCKRODT FIN 5.5% 15/04/25 144A	44,250	40,058	0.02
USD	37,000	INTELSAT JACK 8% 15/02/24 144A	37,000	38,943	0.02
USD	54,000	INTELSAT LUX 7.75% 01/06/21	26,465	28,755	0.02
USD	23,000	INTELSAT JACKSON 9.5000% 30/09/22	27,230	26,508	0.02
USD	25,000	TR OP / TR FI 5.3750% 01/09/25 144A	25,000	25,875	0.01
USD	25,000	INTELSAT JACK 7.25% 15/10/20 GDT	23,438	23,500	0.01
USD	25,000	INTELSAT CONNECT 12.5% 1/04/22 144A	24,094	21,875	0.01

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	13,000	INTELSAT LUX 6.75% 01/06/18	7,296	12,675	0.01
			2,747,448	1,877,684	1.06
		合計: ルクセンブルグ	2,747,448	1,877,684	1.06
		メキシコ			
国債					
MXN	203,989	MEXICAN BONOS DES 6.5% 9/06/22 M	1,418,390	990,867	0.55
MXN	90,000	MEXICAN BONOS DES 4.75% 14/06/18 M	664,958	451,325	0.26
MXN	60,000	MEXICAN BONOS DES 8.5% 31/5/29 M	533,837	322,287	0.18
MXN	50,000	MEXICAN BONOS DES 7.75% 13/11/42 M	416,062	251,637	0.14
MXN	12,700	MEXICAN FIXED RATE 8% 07/12/23 M 20	71,660	65,483	0.04
MXN	2,111	MEXICAN BONOS DES 8.5% 18/11/38	10,109	11,466	0.01
MXN	91	MEXICAN BONOS DES 8% 07/11/47 M	472	469	0.00
			3,115,488	2,093,534	1.18
普通社債(固定金利債)					
USD	70,000	GRUPO BIMBO S 4.7000% 10/11/47 144A	70,805	70,550	0.04
USD	60,000	PETROLEOS MEX 6.5000% 13/03/27 144A	63,292	65,580	0.04
			134,097	136,130	0.08
		合計: メキシコ	3,249,585	2,229,664	1.26
		オランダ			
普通社債(固定金利債)					
EUR	450,000	RABOBANK NED 3.875% 25/07/23	639,508	626,857	0.35
USD	300,000	ING GROEP NV 3.95% 29/03/27	298,824	312,539	0.18
USD	250,000	CONSTELLUM NV 6.625% 01/03/25 144A	232,500	263,438	0.15
USD	250,000	LBC TANK TERM 6.875% 15/05/23 144A	263,750	260,313	0.15
USD	200,000	ZIGGO BONG FIN 5.875% 15/01/25 144A	200,000	196,500	0.11
USD	128,000	ZIGGO SEC 5.5% 15/01/27 144A	128,000	127,040	0.07
EUR	100,000	BAYER CAP CORP 1.25% 13/11/23 EMTn	123,258	125,633	0.07
USD	50,000	PETROBRAS GBL FIN 6.85% 05/06/2115	44,518	48,000	0.03
USD	35,000	OI EUROPEAN G 4.0000% 15/03/23 144A	35,000	35,047	0.02
USD	30,000	PETROBRAS GBL FIN 7.375% 17/01/27	32,602	33,030	0.02
			1,997,960	2,028,397	1.15
		合計: オランダ	1,997,960	2,028,397	1.15
		ポーランド			
国債					
PLN	2,500,000	POLAND GVT BOND 5.75% 23/09/22 0922	778,499	818,677	0.46
PLN	2,500,000	POLAND GVT BOND 5.75% 25/10/21 1021	783,096	807,418	0.46
			1,561,595	1,626,095	0.92
		合計: ポーランド	1,561,595	1,626,095	0.92
		プエルトリコ			
ステップアップ/ダウン債					
USD	20,000	PUERTO RICO SALES 0% 01/08/32	15,040	1,950	0.00
			15,040	1,950	0.00
普通社債(固定金利債)					
USD	245,000	PUERTO RICO SALES FIRS 5.25% 1/8/41	163,847	23,887	0.02
USD	95,000	PUERTO RICO CMWL SERA 5.375% 1/7/33	74,456	21,137	0.02
USD	270,000	PUERTO RICO SALES 0% 01/08/34	46,842	8,444	0.01
USD	80,000	PUERTO RICO SALES TAX 5.375% 1/8/39	33,880	7,799	0.00
USD	10,000	PUERTO RICO AQUE 5% 01/07/33	6,969	6,162	0.00
USD	55,000	PUERTO RICO SALES 5.5% 01/08/42	38,981	5,363	0.00

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	45,000	PUERTO RICO SALES TAX 5.25% 1/08/27	34,998	4,388	0.00
USD	5,000	PUERTO RICO CMWLTH 5.5% 01/07/28	3,698	3,081	0.00
USD	25,000	PUERTO RICO SALES TAX 5.5% 01/08/37	20,442	2,438	0.00
USD	10,000	PUERTO RICO CMWLTH 5.5% 01/07/32	7,000	2,213	0.00
USD	20,000	PUERTO RICO SALES 5% 01/08/43	9,546	1,950	0.00
USD	15,000	PUERTO RICO SALES TAX 6% 01/08/39	12,480	1,463	0.00
USD	15,000	PUERTO RICO SALES TAX 5% 01/08/35 C	11,464	1,463	0.00
USD	15,000	PUERTO RICO SALES TAX 5.75% 1/08/37	12,576	1,463	0.00
USD	10,000	PUERTO RICO SALES TAX 5.5% 01/08/28	7,813	975	0.00
USD	5,000	PUERTO RICO SALES 5.25% 01/08/43	3,465	488	0.00
			<u>488,457</u>	<u>92,714</u>	<u>0.05</u>
		合計: プエルトリコ	<u>503,497</u>	<u>94,664</u>	<u>0.05</u>
		韓国			
普通社債(固定金利債)					
USD	600,000	KOREA DEVEL BK 3% 14/09/22	595,542	598,320	0.34
USD	200,000	EXP-IMP BK KOREA 4% 29/01/21	212,391	205,923	0.12
			<u>807,933</u>	<u>804,243</u>	<u>0.46</u>
		合計: 韓国	<u>807,933</u>	<u>804,243</u>	<u>0.46</u>
		シンガポール			
変動金利債					
USD	400,000	UTD OVERSEAS BK FRN 19/09/24 EMTN	403,063	404,476	0.23
			<u>403,063</u>	<u>404,476</u>	<u>0.23</u>
		合計: シンガポール	<u>403,063</u>	<u>404,476</u>	<u>0.23</u>
		南アフリカ			
国債					
ZAR	3,410,000	REP OF STH AFRICA 8.75% 31/1/44 204	202,271	248,858	0.14
ZAR	1,340,000	REP OF STH AFRIC 8.25% 31/3/32 2032	91,517	99,446	0.06
ZAR	680,000	REP OF STH AFRICA 7% 28/2/31 R213	43,052	45,902	0.03
ZAR	220,000	REP OF STH AFRI 8.875% 28/2/35 2035	15,807	16,766	0.01
ZAR	140,000	REP OF STH AFRICA 6.5% 28/2/41 R214	7,548	8,011	0.00
			<u>360,195</u>	<u>418,983</u>	<u>0.24</u>
		合計: 南アフリカ	<u>360,195</u>	<u>418,983</u>	<u>0.24</u>
		スペイン			
その他債券					
USD	63,888	ABENGOA ABENEWCO PIK 31/03/23 144A	54,239	6,805	0.00
			<u>54,239</u>	<u>6,805</u>	<u>0.00</u>
普通社債(固定金利債)					
USD	75,000	BANCO SANTANDER 3.8000% 23/02/28	75,372	74,954	0.05
			<u>75,372</u>	<u>74,954</u>	<u>0.05</u>
		合計: スペイン	<u>129,611</u>	<u>81,759</u>	<u>0.05</u>
		イギリス			
変動金利債					
USD	350,000	RBS FRN 29/03/49 U	370,750	347,805	0.20
USD	200,000	LLOYDS BANKING GR FRN 27/06/2166	196,000	226,870	0.13
USD	75,000	HSBC HDGS FRN 22/11/65	75,000	78,844	0.04
USD	50,000	BARCLAYS PLC FRN 30/06/49	48,625	51,313	0.03
			<u>690,375</u>	<u>704,832</u>	<u>0.40</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(%)
国債					
GBP	10,000	UK TREAS GILT 3.25% 22/01/44	16,967	17,590	0.01
			16,967	17,590	0.01
普通社債(固定金利債)					
GBP	350,000	HSBC HLDGS PLC 6.75% 11/09/28	675,917	632,338	0.35
USD	300,000	BARCLAYS BANK PLC 7.625% 21/11/22	328,875	339,000	0.19
USD	230,000	INTL GAME 6.5% 15/02/25 144A	218,150	257,025	0.15
USD	200,000	VIRGIN MEDIA FIN 5.75% 15/01/25 144	201,688	204,000	0.12
USD	125,000	BARCLAYS PLC 4.375% 12/01/26	130,489	130,016	0.07
USD	25,000	ENSCO PLC 5.75% 01/10/44	14,750	17,125	0.01
			1,569,869	1,579,504	0.89
		合計: イギリス	2,277,211	2,301,926	1.30
アメリカ					
資産担保証券					
USD	1,050,000	HLA 2015- 2A A CLO FRN 25/07/27	1,039,339	1,050,671	0.58
USD	833,619	ZCCP 2015 1A A1 CLO FRN 16/07/27	819,610	834,038	0.47
USD	465,000	GSAMP 06-HE1 M1 FRN 25/01/36	384,787	441,971	0.25
USD	425,000	RAMP 06 RZ1 M3 FRN 25/03/36	339,468	411,500	0.23
USD	307,332	MSAC 05-HE3 M4 FRN 25/07/35	266,610	310,007	0.18
USD	350,000	NAVSL 2016-5A A 1.7374% 25/07/65	292,990	300,025	0.17
USD	285,000	SVHE 05-2 M5 FRN 25/07/35	252,225	285,417	0.16
USD	350,000	SLMA 2008-5 A4 FRN 25/07/23	259,709	265,004	0.15
USD	250,000	EFSV2 2012-1 A2 FRN 25/03/36	253,152	256,758	0.15
USD	250,000	PARL 15-1A A CLO FRN 20/07/27	249,350	250,208	0.14
USD	250,000	NAVSL 2017-5A A FRN 26/07/66	242,476	243,596	0.14
USD	250,000	NAVSL 2017-2A A FRN 27/12/66	228,675	231,408	0.13
USD	500,000	SLMA 03-1 A5A FRN 15/12/32	208,347	220,518	0.12
USD	250,000	SLMA 2007-1 A5 FRN 26/01/26	165,678	173,651	0.10
USD	200,000	HELT 2007-FRE1 2A FRN 25/04/37	122,000	172,875	0.10
USD	160,000	COMET 2014-A4 A4 FRN 15/06/22	160,738	160,654	0.09
USD	200,000	PHEAA 2016-1A A FRN 25/09/65	156,463	158,856	0.09
USD	150,000	FBSI 05-2 M2 FRN 25/09/35	131,438	150,101	0.08
USD	150,000	ALFT 2012-1A A2 FRN 27/12/44	149,385	149,822	0.08
USD	150,000	NSLT 2006-1 A6 FRN 23/08/36	141,000	146,537	0.08
USD	250,000	SLMA 2003-7A A5A FRN 15/12/33	140,207	139,772	0.08
USD	150,000	NAVSL 2016-7A A FRN 25/03/66	132,543	135,624	0.08
USD	150,000	ECMC 2016-A1 A FRN 26/07/66	112,647	113,689	0.06
USD	120,000	AMIT 2005-4 M3 FRN 25/10/35	96,600	113,603	0.06
USD	500,000	APID 2012-10A A CLO FRN 30/10/22	108,965	109,292	0.06
USD	100,000	SLMA 2008-8 A4 FRN 25/04/23	101,600	102,529	0.06
USD	100,000	MHESA 2012-1 A3 FRN 20/07/43	97,060	101,494	0.06
USD	100,000	SLMA 2008-6 A4 FRN 25/07/23	100,250	101,255	0.06
USD	100,000	SLMA 2005-5 A5 FRN 25/10/40	94,750	99,361	0.06
USD	100,000	JPMAC 06-CHI M1 FRN 25/07/36	82,000	98,641	0.06
USD	100,000	CARR 06-RFC1 A4 FRN 25/05/36	80,375	97,973	0.06
USD	100,000	NEF 2007-1 A1 FRN 28/04/30	83,868	85,006	0.05
USD	110,000	CARR 2005-NC1 M3 FRN 25/02/35	68,993	83,348	0.05
USD	100,000	SLMA 08-4 A4 FRN 25/07/22	79,155	80,550	0.05
USD	80,000	TAOT 17-B A2A FRN 15/01/20	79,998	79,821	0.05
USD	510,000	HEMT 04-5 M2 FRN 25/02/35	73,321	77,821	0.04
USD	80,000	GSA 2005-10 M4 FRN 25/06/35	71,500	77,804	0.04
USD	100,000	SLMA 2008-3 A3 FRN 25/10/21	66,872	66,873	0.04
USD	100,000	SLMA 05-4 A3 FRN 25/01/27	59,705	62,395	0.04
USD	100,000	SLMA 08-2 A3 FRN 25/04/23	59,977	62,046	0.04
USD	200,000	SCHOL 10-A A FRN 28/10/41	57,584	58,972	0.03
USD	270,000	PPSI 04-WHQ1 M4 FRN 25/09/34	51,366	58,958	0.03
USD	200,000	ACE 06-ASP4 A2C FRN 25/08/36	40,909	50,505	0.03

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	COMET 15-A1 A1 FRN 15/01/21	49,992	49,969	0.03
USD	110,000	VOLT 15-NPL8 A1 3.5% 26/06/45	44,601	44,651	0.03
USD	44,000	ALLYA 2017-3 A2 1.53% 16/03/20	43,998	43,931	0.02
USD	100,000	NAVSL 2016-6A A1 1% 25/03/66	40,512	40,585	0.02
USD	30,000	COMET 16-A1 A1 FRN 15/02/22	30,185	30,127	0.02
USD	200,000	NSLT 2005-4 A3 FRN 22/06/26	22,142	22,445	0.01
USD	100,000	SLMA 2003-14 A5 FRN 25/01/23	11,961	12,117	0.01
USD	100,000	HEF 2005-1 A4 FRN 25/02/30	7,045	7,175	0.00
			8,054,121	8,521,949	4.82

バンクローン

USD	2,150,000	CLEAR CHANNEL COM FRN 30/07/19 TE01	2,140,874	1,615,563	0.92
USD	1,167,902	TIBCO SOFTWARE FRN 14/12/20 TB01	1,113,321	1,172,771	0.67
USD	1,046,848	ADVANTAGE FRN 23/07/21 1STINIT TL	1,031,547	1,023,947	0.59
USD	971,944	AMERICAN TIRE FRN 24/9/21 INIT TL	967,084	980,297	0.56
USD	973,178	INFORMATICA DOLLAR FRN 30/6/22 TL	970,745	977,956	0.56
USD	950,177	ALBERTSONS LLC FRN 25/08/21 TB4	944,386	932,735	0.54
USD	869,137	COMPUWARE FRN 11/12/21 1ST LIEN TB3	825,681	875,795	0.51
USD	869,743	UNIVISION REPLA FRN 15/03/24 TL	863,951	868,247	0.50
USD	786,007	GATES GLOB FRN 31/03/24 TB2	776,617	791,356	0.46
USD	750,000	RITE AID CORP FRN 21/8/20 2ND TL1	752,813	754,065	0.44
USD	745,577	INFOR US FRN 01/02/22 TB601	734,475	748,843	0.43
USD	729,375	PRO MACH GP FRN 15/10/21 1ST USD TL	722,081	735,531	0.43
USD	710,780	LIFE TIME FITNESS FRN 10/06/22 TB	708,192	713,815	0.41
USD	693,525	TRAVEL PORT FRN 02/09/21 TC	684,841	694,156	0.40
USD	656,524	YORK RISK SVC FRN 1/10/21 INIT TL	651,100	644,215	0.37
USD	642,543	WMG ACQUISITION FRN 01/11/23 TE01	620,722	643,899	0.37
USD	625,930	CITYCENTER HDGS FRN 07/04/24 TB	622,800	629,492	0.37
USD	614,460	AVOLON FRN 20/01/22 TB2	613,146	610,859	0.35
USD	602,740	ALPHA TOPCO FRN 01/02/24 NEW 1STL3	599,101	606,884	0.34
USD	620,680	CENGAGE LEARN FRN 07/06/23 TLB	616,723	594,214	0.34
USD	682,402	CUMULUS MEDIA FRN 19/12/20 TL01	675,544	588,667	0.33
USD	568,157	MICRO HO FRN 15/09/24 1ST LIEN TL01	565,634	570,714	0.32
USD	589,543	OPAL ACQ FRN 21/11/20 1ST TB	588,537	552,254	0.31
USD	550,854	DELL FRN 07/09/23 TB	551,822	551,231	0.31
USD	542,939	FITNESS INT FRN 01/07/20 TL B	539,771	550,812	0.31
USD	547,250	FLEX ACQUISIT FRN 16/12/23 INIT TL	551,354	550,758	0.31
USD	516,192	FIRST DATA CORP 2 FRN 08/07/22 TL01	513,986	517,129	0.29
USD	500,000	MAXAR TECHNO FRN 07/07/24 TB	497,500	503,125	0.28
USD	493,763	PQ CORPORATION FRN 04/11/22 TB	498,083	498,436	0.28
USD	495,000	ANCESTRY FRN 19/10/23 TB	492,525	498,017	0.28
USD	497,500	SPRINT COMM FRN 2/02/24 INIT TL	499,366	497,935	0.28
USD	496,250	MILACRON LLC FRN 28/09/23 TL B	494,389	497,389	0.28
USD	494,933	MACOM TECHNO FRN 19/05/24 TL	490,231	494,624	0.28
USD	490,472	BMC INITIAL US FRN 10/09/22 TB201	489,030	491,728	0.28
USD	488,775	GREENWAY HEALTH FRN 16/02/24 TL	483,887	491,219	0.28
USD	484,972	TRANS UNION FRN 09/04/23 TB3	478,910	487,428	0.28
USD	485,000	AMERICAN AIRLINES 1 FRN 12/10/21 TL	481,363	486,128	0.28
USD	485,047	AMERICAN AIRLINE FRN 27/06/20 TL	481,409	485,906	0.28
USD	483,750	TRANSDIGM FRN 09/06/23 TF01	478,913	485,025	0.27
USD	477,024	DAVITA HEALTHCARE FRN 02/06/21 TB	475,236	481,497	0.27
USD	479,062	SEATTLE ESC FRN 21/04/24 TL	477,864	480,061	0.27
USD	493,769	NUMERICABLE USD FRN 31/07/25 TB11	492,534	473,648	0.27
USD	483,534	COMMUNICATIONS SAL FRN 24/10/22 TB	483,534	468,020	0.26
USD	465,417	BURLINGTON COAT FRN 17/11/24 TB501	461,926	466,776	0.26
USD	465,713	LEVEL 3 FINANCING FRN 15/02/24 TB	464,549	466,379	0.26
USD	461,185	FIRST DATA 2024A FR FRN 26/04/24 TL	457,647	461,927	0.26
USD	601,947	PETCO ANIMAL SUP FRN 26/1/23 2NDTB1	588,057	457,103	0.26
USD	482,030	OPTIV FRN 01/02/24 INIT 1STL	486,851	451,301	0.26
USD	448,004	US FOODS FRN 15/06/23 INTL TL	446,884	451,124	0.26

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	485,006	ACOSTA INC FRN 26/09/21 INIT TL	485,006	428,423	0.24
USD	425,000	ZIGGO BV FRN 15/04/25 TLE	423,938	422,167	0.24
USD	413,357	RBS GLOBAL FRN 21/08/24 TB01	410,256	415,554	0.24
USD	504,586	PETSMART FRN 11/03/22 TB 201	502,572	405,203	0.23
USD	430,664	OPAL ACQ FRN 21/11/20 1ST TB02	429,929	403,425	0.23
USD	400,000	CONSOL CONT FRN 09/05/24 TB1	403,000	402,166	0.23
USD	399,572	UNIVAR USA FRN 01/7/22 DOLL INITL01	397,574	401,354	0.23
USD	398,702	ZEBRA TECHNO FRN 27/10/21 TB	395,711	400,896	0.23
USD	398,000	CPG INTERNATIONAL L FRN 05/05/24 TL	400,985	399,660	0.23
USD	403,100	SEARS HLDG EXT FRN 18/01/19 TL01	393,248	399,573	0.23
USD	483,668	NEIMAN MARCUS FRN 25/10/20 TL01	480,041	396,308	0.22
USD	383,541	VALEANT PHARMA FRN 01/04/22 TB01	381,737	389,446	0.22
USD	382,301	CATALENT P FRN 20/05/24 1ST LIEN TL	382,301	384,333	0.22
USD	381,012	RACKSPACE HOS FRN 26/10/23 TB	379,107	381,357	0.22
USD	377,871	HILTON W FRN 25/10/23 NEW SER TB2	376,454	380,175	0.22
USD	377,034	BRAND ENERGY FRN 16/06/24 TL02	373,263	378,991	0.21
USD	376,235	KINETIC CONCEP FRN 24/1/24 TL	374,354	375,059	0.21
USD	372,637	GOBP HOLDI FRN 21/10/21 1ST LIEN TB	369,866	373,338	0.21
USD	368,860	PRESTIGE FRN 20/01/24 TB4	367,938	371,684	0.21
USD	354,870	BRIGHT BID FRN 17/03/24 1ST LIEN TB	355,027	357,679	0.20
USD	352,452	VISTRA EXIT FRN 04/08/23 TL01	348,927	354,655	0.20
USD	347,379	GREENEDEN FRN 17/11/23 TB201	342,169	349,768	0.20
USD	344,466	CAPITAL AUTOMOTIVE 21/03/24 1ST TB2	342,743	345,843	0.20
USD	343,896	CCM MERGER FRN 08/08/21 TLB	342,176	345,658	0.20
USD	339,447	LINEAGE LOGIST FRN 07/04/21 TL	336,053	341,199	0.19
USD	332,367	NEXSTAR BROADCAST FRN 17/01/24 TB2	331,536	333,701	0.19
USD	326,484	CSC HOLDING FRN 17/07/25 NEW TL01	324,036	325,693	0.18
USD	317,434	CERIDIAN CORP FRN 15/9/20 REPS1STTL	317,537	318,557	0.18
USD	310,821	BERLIN PACK REPL FRN 01/10/21 TL	310,219	313,325	0.18
USD	311,241	REYNOLDS GP CO 2017 FRN 5/2/23 TL03	312,798	313,117	0.18
USD	413,681	REVLON CONSUM FRN 07/09/23 INITTB02	410,042	309,485	0.18
USD	303,283	SCIENTIFIC GAMES FRN 14/08/24 TB401	301,767	306,105	0.17
USD	299,057	MINERALS TECHNO FRN 31/05/21 TB2	298,309	303,916	0.17
USD	292,622	MISYS FRN 26/04/24 1ST LIEN TL01	291,159	293,769	0.17
USD	288,683	ENERGY FUTURE FRN 26/06/18 TL	288,322	289,662	0.16
USD	275,000	CEOC CAESARS FRN 03/04/24 TB01	273,625	275,710	0.16
USD	274,313	TEMPO ACQ INIT FRN 12/05/24 INIT TL	272,941	273,712	0.15
USD	269,045	PRISO ACQ FRN 01/05/22 TB	267,700	270,558	0.15
USD	268,219	PARTY CITY FRN 19/08/22 TL04	267,548	269,561	0.15
USD	246,062	CAPITAL AUTO FRN 21/3/25 2NDLIEN TL	243,602	253,444	0.14
USD	248,125	ABACUS INNOV FRN 09/06/23 TLB	247,505	250,607	0.14
USD	246,235	BERLIN PACK REPL FRN 01/10/21 TL02	245,758	248,218	0.14
USD	240,000	DOLLAR TREE FRN 26/05/22 TB2	240,000	242,100	0.14
USD	221,118	WME ENTERTAINMENT FRN 6/5/21 1STL01	218,354	222,500	0.13
USD	217,182	POST HOLDINGS SERIE FRN 26/05/24 TL	216,639	218,230	0.12
USD	210,235	MA FINANCE FRN 19/11/21 NEW B2 TL01	200,156	210,739	0.12
USD	200,000	DIAMOND BC FRN 25/07/24 TL	199,000	200,502	0.11
USD	198,496	LESLIES POOLSMART FRN 16/8/23 TB1	198,000	198,266	0.11
USD	200,000	AVAYA INC FRN 09/11/24 1ST LIEN TL	198,000	197,063	0.11
USD	194,400	TRANSDIGM INC FRN 16/08/24 TG	193,914	195,548	0.11
USD	191,103	ASURION FRN 04/08/22 1ST LIEN TB4	189,543	192,238	0.11
USD	181,818	POST HOLDINGS SER FRN 26/05/24 TL02	181,364	182,695	0.10
USD	180,814	TTM TECHNOLOGIES FRN 15/09/24 TB	179,910	181,154	0.10
USD	153,305	SABRE FRN 18/02/24 TB3	152,347	154,192	0.09
USD	151,230	ON SEMI 2017 NEW R FRN 31/03/23 TB2	148,961	152,104	0.09
USD	150,000	DIMORA BRA FRN 15/08/24 1ST LIEN TL	148,500	151,500	0.09
USD	150,000	VIRGIN MEDIA K FRN 31/01/26 TL	149,625	150,170	0.08
USD	148,877	GREENEDEN FRN 17/11/23 TB202	146,644	149,900	0.08
USD	134,862	DYNEGY FIN ESC FRN 07/02/24 TC201	133,514	135,668	0.08
USD	128,057	GO DADDY FRN 15/02/24 TL	127,920	128,545	0.07

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	114,876	REYNOLDS GP EVER 2017 FRN 5/2/23 TL	115,450	115,568	0.07
USD	114,680	MPH ACQ FRN 25/05/23 INIT TL	114,552	115,038	0.07
USD	113,179	PARTY CITY FRN 19/08/22 TL02	112,896	113,746	0.06
USD	110,905	JAGUAR HDG CIE 17 FRN 18/08/22 TL02	110,325	111,201	0.06
USD	100,916	BERLIN PACK REPL FRN 01/10/21 TL03	100,721	101,729	0.06
USD	100,000	CVENT INC FRN 29/11/23 TL	99,750	100,250	0.06
USD	99,652	JAGUAR HDG CIE FR FRN 18/08/22 TL01	99,131	99,919	0.06
USD	99,003	KFC HOLDING FRN 16/06/23 NEW TB	98,507	99,714	0.06
USD	100,000	SYNIVERSE HLDGS FRN 23/04/19 TL	96,838	98,469	0.06
USD	96,139	GO DADDY FRN 25/02/24 TL02	96,035	96,505	0.05
USD	95,354	BURGER KING/TIM FRN 17/02/24 TL B3	95,134	95,430	0.05
USD	92,046	VISTRA EXIT FRN 04/08/23 TL03	91,126	92,622	0.05
USD	121,716	REVLON CONSUM FRN 07/09/23 INITB01	120,645	91,059	0.05
USD	90,000	U RADIATE HOLDCO FRN 09/12/23 TL	89,100	89,462	0.05
USD	86,498	VERTIV GROUP CORP FRN 30/11/23 TB1	83,903	86,552	0.05
USD	82,460	SCIENTIFIC GAMES FRN 14/08/24 TB402	82,048	83,227	0.05
USD	81,728	CITGO PETROLEUM FRN 09/05/18 TL01	82,341	82,749	0.05
USD	78,571	VISTRA EXIT FRN 04/08/23 TL02	77,786	79,062	0.04
USD	76,000	KRONOS INC FRN 20/10/24 TB	75,240	79,059	0.04
USD	74,625	BWAY CORP FRN 03/04/24 INIT TL	74,252	75,031	0.04
USD	74,284	BRIGHT BID FRN 17/03/24 1ST LIEN TB	74,317	74,872	0.04
USD	74,625	TEAM HEALTH FRN 12/01/24 INITL	74,438	72,853	0.04
USD	71,865	BRAND ENERGY FRN 16/06/24 TL	71,147	72,238	0.04
USD	70,938	MIAMI ESC FRN 21/04/24 TB301	70,761	71,086	0.04
USD	70,133	REYNOLDS GPPAC 2017 FRN 5/2/23 TL02	70,483	70,555	0.04
USD	70,976	YORK RISK SVC FRN 1/10/21 1ST TB02	70,389	69,645	0.04
USD	165,069	NEW MILLENIUM HOLD FRN 21/12/20 TL	404,186	66,991	0.04
USD	61,288	CHANGE HEALTH CL FRN 03/02/24 TL04	61,134	61,468	0.03
USD	61,048	BURGER KING/TIM FRN 17/02/24 TB302	60,908	61,097	0.03
USD	59,690	COVERIS HDG FRN 26/06/22 TB1	59,391	59,867	0.03
USD	55,695	MISYS FRN 26/04/24 1ST LIEN TL03	55,417	55,913	0.03
USD	60,625	GETTY IMAGES FRN 18/10/19 INIT TL01	50,086	55,396	0.03
USD	54,975	TRANSDIGM INC FRN 16/08/24 TG02	54,838	55,300	0.03
USD	53,264	QUORUM HEALTH FRN 12/04/22 TL02	53,119	53,930	0.03
USD	50,000	CHESAPEAKE NRJ FRN 23/8/21 CL A TL	50,000	53,363	0.03
USD	50,000	ASURION R FRN 04/08/25 2ND LIEN TB2	50,000	51,484	0.03
USD	50,683	MISYS FRN 26/04/24 1ST LIEN TL02	50,429	50,881	0.03
USD	49,875	GATEWAY CASINO FRN 14/2/23 INITB1	49,626	50,389	0.03
USD	49,750	EVERI PAYMENTS FRN 27/04/24 TB	49,501	50,316	0.03
USD	50,000	SEMINOLE TRIBE FRN 26/06/24 TB	49,750	50,304	0.03
USD	50,000	NAVISTAR FRN 24/11/24 TB	49,750	50,258	0.03
USD	49,563	MOHEGAN TRIBAL FRN 13/10/23 TB	49,067	50,082	0.03
USD	49,750	RHP HOTEL PROP FRN 19/04/24 TB01	49,750	50,030	0.03
USD	49,740	CHARTER COMMUNIC FRN 03/01/21 TL	50,051	49,852	0.03
USD	49,125	21ST CENT ONC FRN 14/04/22 TB	48,634	46,751	0.03
USD	45,948	OPAL ACQ FRN 21/11/20 TB03	45,869	43,042	0.02
USD	48,755	HOMER CITY FRN 08/02/23 1ST TB	45,342	42,498	0.02
USD	41,971	MISSION BROAD FRN 17/01/24 TB2	41,866	42,139	0.02
USD	47,467	SERTA SIMM FRN 21/10/24 2ND INIT TL	46,755	40,881	0.02
USD	41,478	SYNIVERSE HLDGS FRN 23/04/19 INITL	40,167	40,843	0.02
USD	39,700	WESTERN DIGITAL US FRN 29/04/23 TB3	39,700	39,889	0.02
USD	35,748	ZAYO 2017 INCR FRN 13/01/24 TB2	35,659	35,909	0.02
USD	47,228	AMERICAN NRG FRN 4/8/20 INIT 1STL	41,088	35,264	0.02
USD	34,688	LIONS GATE ENT FRN 08/12/23 TB01	34,514	34,796	0.02
USD	32,625	CHANGE HEALTH CL FRN 03/02/24 TL02	32,544	32,721	0.02
USD	31,637	ENERGY FUTURE FRN 26/06/18 TL02	31,597	31,744	0.02
USD	32,051	SUPERVALU INC FRN 02/06/24 TB	31,971	31,410	0.02
USD	28,711	CAMELOT FRN 03/10/23 TL02	28,567	28,918	0.02
USD	25,000	U DECK CHASSIS ACQU FRN 15/06/23 TL	24,875	25,500	0.01
USD	25,000	WINK HOL FRN 01/11/25 2ND LIEN TL01	24,875	25,313	0.01

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	25,000	USS ULTIMA FRN 25/08/25 2ND LIEN TL	25,000	25,281	0.01
USD	25,000	BIG RIVER STEEL FRN 15/08/23 TL	24,750	25,281	0.01
USD	25,000	VENATOR INTL FRN 28/06/24 TL	24,938	25,234	0.01
USD	24,938	UNIFRAX DOL FRN 31/03/24 INITL	24,875	25,234	0.01
USD	25,000	HD SUPPLY FRN 19/07/24 TL	24,938	25,227	0.01
USD	25,000	USS ULTIMA FRN 25/08/24 1ST LIEN TL	25,000	25,198	0.01
USD	25,000	CPI INTERN FRN 24/07/24 1ST LIEN TL	25,000	25,198	0.01
USD	24,938	IPAYMENT FRN 11/04/23 TL01	24,688	25,187	0.01
USD	25,000	U ARAMARK SERVICES FRN 07/03/25 TB	25,000	25,160	0.01
USD	25,000	HELIX ACQU FRN 28/09/25 2ND LIEN TL	24,750	25,156	0.01
USD	25,000	WINK HOL FRN 01/11/24 1ST LIEN TL01	24,938	25,156	0.01
USD	25,000	RP CROWN PARENT FRN 12/10/23 TL	25,000	25,152	0.01
USD	25,000	PAREXEL INTERNATIONAL FRN 27/09/24 TL	24,875	25,141	0.01
USD	24,874	MICRON TECHNO FRN 26/04/22 TL	24,812	25,131	0.01
USD	25,000	U PLAYA RESORTS AND FRN 27/04/24 TL	24,938	25,099	0.01
USD	24,937	ASURION FRN 03/11/23 1ST LIEN TB5	24,937	25,087	0.01
USD	25,000	USI HOLDINGS FRN 15/05/24 TL01	24,875	25,000	0.01
USD	24,813	BERRY PLASTICS CORP FRN 13/01/24 TN	24,813	24,943	0.01
USD	24,750	UFC HOLDINGS FRN 22/07/23 TL	24,936	24,916	0.01
USD	24,875	CALPINE CORPORAT FRN 31/12/19 TL	24,626	24,898	0.01
USD	25,000	NEENAH FRN 13/12/22 TL	24,750	24,875	0.01
USD	25,000	SURGERY PARTNERS FRN 19/06/24 TL	24,938	24,781	0.01
USD	24,875	RADIATE HOLDCO DATE FRN 8/12/23 TL	24,751	24,726	0.01
USD	24,586	AIR METHODS FRN 12/04/24 INIT TL	24,463	24,582	0.01
USD	23,990	CHANGE HEALTH CL FRN 03/02/24 TL01	23,930	24,061	0.01
USD	24,874	FORTERRA FIN REPL FRN 25/10/23 TL	24,874	23,341	0.01
USD	22,768	COLUMBUS MCKIN FRN 20/01/24 TL	22,654	22,967	0.01
USD	24,868	MURRAY ENERGY FRN 16/04/20 TL B2	23,748	22,004	0.01
USD	29,291	HERCULES OFF FRN 14/1/19 1ST TL	17,685	21,968	0.01
USD	21,815	DTZ FRN 04/11/21 INIT 1ST TL07	21,706	21,565	0.01
USD	20,791	CAMELOT FRN 03/10/23 TL01	20,687	20,941	0.01
USD	20,185	WME ENTERTAINMENT FRN 6/5/21 1STL02	19,933	20,312	0.01
USD	19,231	SUPERVALU DELAYED D FRN 02/06/24 TL	19,231	18,846	0.01
USD	17,833	PARTY CITY FRN 19/08/22 TL03	17,788	17,922	0.01
USD	17,290	CHANGE HEALTH CL FRN 03/02/24 TL03	17,247	17,341	0.01
USD	17,000	PEABODY NRG FRN 31/03/21 TL	16,915	17,253	0.01
USD	14,125	GOLDEN NUGGET LANDR FRN 04/10/23 TB	14,125	14,249	0.01
USD	11,864	ENERGY FUTURE FRN 26/06/19 TL03	11,849	11,904	0.01
USD	10,749	GOLDEN NUGGET LAND FRN 04/10/23 TB2	10,749	10,844	0.01
USD	10,714	DONNELLEY FIN SOLUT FRN 29/09/23 TB	10,661	10,795	0.01
USD	9,309	DTZ FRN 04/11/21 INIT 1ST TL01	9,262	9,203	0.01
USD	8,545	PARTY CITY FRN 19/08/22 TL01	8,524	8,588	0.00
USD	6,847	REVLON CONSUM FRN 07/09/23 INITTB03	6,786	5,122	0.00
USD	2,711	ADVANTAGE FRN 23/07/21 1STINIT TL11	2,671	2,652	0.00
USD	2,361	ADVANTAGE FRN 23/07/21 1STINIT TL02	2,327	2,310	0.00
USD	1,781	LIFE TIME FITNESS FRN 10/06/22 TB02	1,775	1,789	0.00
USD	1,429	DONNELLEY FIN FRN 29/09/23 TB02	1,421	1,439	0.00
USD	1,328	DTZ FRN 04/11/21 INIT 1ST TL10	1,321	1,313	0.00
USD	1,128	BRAND ENERGY FRN 16/06/24 TL03	1,117	1,134	0.00
USD	967	SCIENTIFIC GAMES FRN 14/08/24 TB403	962	976	0.00
USD	957	RACKSPACE HOSTING FRN 03/11/23 TB5	953	958	0.00
USD	952	HILTON NEW SERIE FRN 25/10/23 TB205	948	958	0.00
USD	558	WME ENTERTAINMENT FRN 06/05/21 TB24	551	562	0.00
USD	532	DTZ.2015 1 FRN 04/11/21 TL02	529	525	0.00
USD	188	BWAY HOLDING INIT FRN 03/04/24 TL03	187	189	0.00
USD	125	EVERI PAYMENTS FRN 27/04/24 TB02	124	126	0.00
USD	83	DTZ.2015 1 FRN 04/11/21 TL09	83	83	0.00
USD	63	GOLDEN NUGGET LAN FRN 04/10/23 TB03	63	64	0.00
USD	63	BERRY PLASTICS FRN 13/01/24 TN03	63	63	0.00
USD	51	WME ENTERTAINMENT FRN 06/05/21 TB25	50	51	0.00

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	24	DTZ 2015 1FRN 04/11/21	TL08	24 54,837,161	24 53,715,434	0.00 30.40
モーゲージ担保証券						
USD	600,000	DBALT 07-OA3 A1 FRN 25/07/47		161,316	178,870	0.11
USD	650,000	LXS 06-16N A4A FRN 25/11/46		136,856	159,771	0.09
USD	5,025,000	GNR 10-20 SE IO FRN 20/02/40		129,445	123,820	0.07
USD	560,000	LXS 06-14N 1A1A FRN 25/09/46		111,693	121,548	0.07
USD	400,000	AHMA 06-2 1A1 FRN 25/09/46		93,405	112,645	0.06
USD	570,000	LXS 05-7N 1A1A FRN 25/12/35		78,559	88,704	0.05
USD	2,500,000	GNR 10-101 S IO FRN 20/08/40		89,719	83,595	0.05
USD	1,059,596	GNR 15-110 IO FRN 20/08/45		85,729	72,017	0.04
USD	200,000	IMSA 07-1 A2 FRN 25/03/37		59,341	67,567	0.04
USD	400,000	LUM 06-7 1A1 FRN 25/12/36		51,184	58,097	0.03
USD	1,000,000	GNR 2015-57 AS IO FRN 20/04/45		59,695	56,575	0.03
USD	1,000,000	GNR 13-181 SA IO FRN 20/11/43		54,785	51,748	0.03
USD	185,000	JPALT 07-A2 12A3 FRN 25/06/37		48,050	51,658	0.03
USD	800,000	IMJA 07-A1 A3 6% 25/08/37		46,479	43,222	0.02
USD	500,000	G2SF 4 2015-159 HS IO FRN 20/11/45		46,158	39,809	0.02
USD	525,000	FNR 14-87 IO FRN 25/01/45		41,848	37,532	0.02
USD	500,000	FNR 15-82 MS IO FRN 25/11/45		44,899	37,154	0.02
USD	500,000	G2SF 5 2012-149 MS IO FRN 20/12/42		21,174	19,778	0.01
USD	775,000	GNR 10-31 SA IO FRN 20/03/40		20,349	18,684	0.01
USD	250,000	GNR 14-41 SA IO FRN 20/03/44		15,803	15,279	0.01
USD	250,000	GNR 2013-134 DS IO FRN 20/09/43		13,586	13,427	0.01
USD	250,000	FHR 4320 SD IO FRN 15/07/39		14,699	13,112	0.01
				1,424,772	1,464,612	0.83
商業不動産担保証券						
USD	2,400,000	WFRBS 14-C21 XA IO 1.36% 15/08/47		190,026	117,471	0.07
USD	1,000,000	CGCMT 15-GC27 XA IO FRN 10/02/48		104,735	74,248	0.04
USD	1,500,000	WFRBS 14-C22 XA IO 0.971% 15/09/57		95,358	62,727	0.04
USD	1,300,000	GSMS 15-GC30 XA IO FRN 10/05/50		78,610	55,143	0.03
				468,729	309,589	0.18
変動金利債						
USD	296,000	GOLDMAN SACHS FRN 29/12/49	L	302,973	305,205	0.16
USD	250,000	JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/01/49		264,374	284,414	0.16
USD	229,000	LINCOLN NATL CORP FRN 17/05/66		232,419	215,260	0.12
USD	190,000	GEN ELECTRIC CO FRN 15/06/66 D		196,853	195,814	0.11
USD	150,000	BANK OF AMERICA CORP FRN 23/10/49 Z		150,875	170,135	0.10
USD	165,000	HARTFORD FINL FRN 12/02/47 ICON		152,100	160,050	0.09
USD	148,000	BANK OF AMERICA CORP FRN 29/07/49 K		155,622	148,503	0.08
USD	141,000	ILFC E-CAP TR II FRN 21/12/65 144A		137,475	136,939	0.08
USD	99,000	MORGAN STANLEY FRN 29/12/49		99,000	103,213	0.06
USD	99,000	MORGAN STANLEY FRN 29/07/49 H		99,966	101,922	0.06
USD	82,000	JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/04/49 1		90,098	83,025	0.05
USD	75,000	JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/12/49 U		75,188	82,125	0.05
USD	75,000	ENTREPRISE PRODUCTS FRN 01/08/66 A	A	76,688	75,000	0.04
USD	70,000	ENERGY TRANSFER FRN 15/02/66 B		70,000	67,988	0.04
USD	66,000	SUMMIT MIDSTREAM FRN 15/06/66 A		66,000	66,825	0.04
USD	50,000	BANK OF AMERICA CORP FRN 29/09/49 X		49,969	55,131	0.03
USD	55,000	DCP MIDSTREAM FRN 15/06/66 A		55,000	54,934	0.03
USD	55,000	VIACOM INC FRN 28/02/57		55,000	54,106	0.03
USD	50,000	CITIGROUP INC FRN 29/12/49	Q	50,000	52,574	0.03
USD	50,000	GOLDMAN SACHS FRN 31/12/49	M	50,219	51,500	0.03
USD	50,000	GOLDMAN SACHS GP FRN 05/06/28		50,000	50,687	0.03
USD	45,000	GOLDMAN SACHS GP FRN 31/10/38		45,383	46,234	0.03
USD	35,000	JPMORGAN CHASE FRN 24/07/38		35,968	36,121	0.02
USD	39,000	GOLDMAN SACHS CAP II FRN 01/12/49		30,018	34,476	0.02

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	25,000	BANK OF AMERICA FRN 29/12/49 DD	25,000	28,250	0.02
USD	25,000	CITIGROUP INC FRN 29/12/49 T	25,000	27,575	0.02
USD	25,000	JPMORGAN CHASE CO FRN 29/12/49 V	24,625	25,510	0.01
			2,665,813	2,713,516	1.54
投資信託					
--	10,970	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING ETF	1,257,332	1,273,946	0.72
--	27,680	SPDR BLOOMBERG BARCLAYS H/Y BD ETF	1,025,069	1,015,856	0.57
--	10,770	ISHARES IBOXX USD H/Y CORP BOND ETF	963,083	939,144	0.53
--	36,494	POWERSHARES SENIOR LOAN ETF	853,020	840,639	0.48
--	13,980	SPDR BBG BARCLAYS SHORTERM HIGH ETF	391,510	385,359	0.22
--	3,200	ISHARES JP MORGAN EM LOCAL C	152,576	154,304	0.09
			4,642,590	4,609,248	2.61
普通株式					
USD	22,087	AVAYA HOLDINGS C	795,387	386,302	0.22
USD	4,875	UCI HOLDINGS INC COMMON STOCK	77,406	146,250	0.08
USD	8,160	HOMER CITY LLC DUMMY	482,591	116,770	0.07
USD	1,991	VISTRA ENERGY CORP	67,395	36,316	0.02
USD	809	LINN ENERGY INC NEW NPV	9,101	32,400	0.02
USD	139,871	HOLDCO COMMON STOCK RBR DUMMY	59,226	17,484	0.01
USD	589	BONANZA CREEK ENERGY INC	6,147	16,292	0.01
USD	354	PEABODY ENERGY CORP	3,674	13,898	0.01
USD	2,968	DENBURY RESOURCES INC	7,243	6,574	0.00
USD	5,174	HERCULES OFFSHORE INC ESC	298,352	3,881	0.00
USD	3,457	WARREN RESOURCES INC	0	3,457	0.00
USD	6,041	NII HOLDINGS INC	122,925	2,681	0.00
USD	160	MIDSTATES PETROLEUM CO INC	152,597	2,654	0.00
USD	3,297	NEW MILLENIUM HOLDCO INC COM	53,348	908	0.00
			2,135,392	785,867	0.44
その他債券					
USD	435,000	ELWOOD ENERGY 8.159% 05/07/26	176,866	175,686	0.10
USD	100,000	RED OAK POWER 9.2% 30/11/29 B	106,438	114,000	0.06
USD	582,274	IHEART COMM INC PIK 14% 01/02/21	523,125	45,126	0.03
USD	9,000	US AIRWAYS 6.75% 2012-2B 03/12/22	7,423	7,556	0.00
USD	570,801	IHEART COMM INC PIK 14% 1/2/21 ESC	0	0	0.00
			813,852	342,368	0.19
ベイ・イン・カインド(PIK)債					
USD	125,000	VERTIV INT HOLD PIK 12% 15/02/22 14	122,500	134,374	0.08
USD	75,000	INFOR SOFT PIK 7.125% 01/05/21 144A	73,656	76,687	0.04
USD	50,000	HUB HOLDINGS PIK 8.125% 15/07/19 14	50,625	50,063	0.03
USD	25,000	POLARIS INT PIK 01/12/22 144A	24,750	25,938	0.01
USD	14,372	NEW DAY ALU PIK 10% 28/10/20	0	14,372	0.01
			271,531	301,434	0.17
ライツ					
--	2,084	VISTRA ENERGY CORP RIGHT RTS	4,752	1,876	0.00
			4,752	1,876	0.00
ステップアップ/ダウン債					
USD	154,000	TERRAFORM GLOBAL 9.75% 15/08/22 144	148,272	170,362	0.10
USD	150,000	MURPHY OIL CORP 3.7% 01/12/22	117,241	150,563	0.09
USD	165,000	ENDO FIN LLC/FIN 5.375% 15/01/23 1	135,275	128,700	0.07
USD	60,000	HP ENTERPRISE CO 4.9% 15/10/25	60,162	63,308	0.04
USD	50,000	A SCHULMAN INC STUP 6.875% 01/06/23	50,000	52,000	0.03
USD	25,000	CRESTWOOD MID 6.25% 01/04/23 WI	25,000	25,980	0.01
USD	25,000	RITE AID CORP 6.875% 15/12/28	27,313	19,250	0.01
			563,263	610,163	0.35

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	650,000	BMC SOFTWARE 8.125% 15/07/21 144A	640,743	654,062	0.38
EUR	500,000	GOLDMAM SACHS GP 2.5% 18/10/21 EMTN	676,051	646,189	0.38
USD	400,000	DAIMLERCHRYSLER NA 8.5% 18/01/31	609,614	603,803	0.35
USD	600,000	APPLE INC 2.4% 03/05/23	575,674	593,474	0.35
USD	500,000	AMGEN INC 4.563% 15/06/48	481,893	556,900	0.33
EUR	400,000	JPMORGAN CHASE CO 2.875% 24/5/28 EM	529,250	551,155	0.32
USD	530,000	ADVANCED MICRO 7% 01/07/24	521,828	549,212	0.32
USD	510,000	KENNEDY WILSON 5.875% 01/04/24	509,999	526,574	0.31
USD	500,000	VERIZON COMM 4.15% 15/03/24	518,964	525,658	0.31
USD	500,000	METLIFE INC 3.6% 10/04/24	507,166	522,821	0.31
USD	500,000	MORGAN STANLEY 3.75% 25/02/23	505,516	517,893	0.30
USD	440,000	GOLDMAN SACHS GP 5.15% 22/05/45	451,421	509,690	0.30
USD	500,000	ANHEUSER-BUSH INBEV 2.5% 15/07/22	480,999	495,957	0.29
USD	500,000	ANHEUSER-BUSCH INBEV 3.75% 15/07/42	477,169	485,748	0.28
USD	400,000	LYNX/VMED 6.375% 15/04/23 144A	425,499	412,499	0.24
USD	375,000	COMMSCOPE TECH FIN 6% 15/06/25 144A	383,987	397,968	0.24
USD	380,000	GRIFFON CORP 5.25% 01/03/22	372,622	383,799	0.23
USD	343,000	SCIENTIFIC GAMES INTL 10% 01/12/22	320,220	376,442	0.22
USD	348,000	ASSOC MATERIAL LLC 9% 1/01/24 144A	369,127	374,969	0.22
USD	350,000	CCO HDGS LLC/CAP 5.75% 01/09/23	351,749	360,499	0.21
USD	350,000	CONSOL ENERGY 5.875% 15/04/22	354,374	357,437	0.21
USD	350,000	MIDAS INT HOLD 7.875% 01/10/22 144A	345,949	352,624	0.21
USD	350,000	UNIT CORP 6.625% 15/05/21	341,249	352,624	0.21
USD	374,000	CENTURLINK INC 7.65% 15/03/42	370,600	329,587	0.20
USD	317,000	INFOR US INC 6.5% 15/05/22 WI	319,938	328,094	0.20
USD	277,000	SUNOCO LP/FIN 6.25% 15/04/21 WI	277,726	287,941	0.17
USD	255,000	HCA INC 7.5% 15/02/22	295,307	286,874	0.17
USD	255,000	HUGHES SATELITE 7.625% 15/06/21	279,943	281,774	0.17
USD	275,000	SONIC AUTO INC 5% 15/05/23	268,038	266,062	0.16
USD	250,000	HOCKEY MERG 7.875% 01/10/21 144A	259,999	260,312	0.16
USD	266,000	DISH DBS CORP 5% 15/03/23	253,910	251,369	0.15
USD	236,000	SPRINT CORP 7.875% 15/09/23	252,717	251,339	0.15
USD	250,000	SUMMIT MID HDGS 5.5% 15/08/22	252,500	251,249	0.14
USD	250,000	ALLY FINANCIAL INC 3.5% 27/01/19	252,500	251,249	0.14
USD	200,000	NEPTUNE FINCO 10.875% 15/10/25 144A	200,000	237,999	0.13
USD	225,000	PRISO ACQ CORP 9% 15/05/23 144A	225,000	237,515	0.13
USD	200,000	CSC HOLDINGS 6.625% 15/10/25 144A	218,500	216,495	0.12
USD	200,000	LTF MERGER 8.5% 15/06/23 144A	200,656	211,749	0.12
USD	207,000	UNITED CONTINENTAL 6.375% 01/06/18	219,453	210,104	0.12
USD	200,000	ZAYO GROUP LLC/CAP 6% 01/04/23	201,220	208,309	0.12
USD	194,000	BOYD GAMING CORP 6.875% 15/05/23	195,005	205,639	0.12
USD	198,000	COTT HDGS INC 5.5% 01/04/25 144a	198,000	203,444	0.12
USD	196,000	PLY GEM INDS 6.5% 01/02/22	191,446	203,104	0.11
USD	208,000	DISH DBS CORP 5.875% 15/11/24	208,006	202,539	0.11
USD	195,000	ONEMAIN FIN 7.25% 15/12/21 144A	199,480	202,253	0.11
USD	200,000	SLM CORP 6.125% 25/03/24 MTN	204,636	201,999	0.11
USD	212,000	DJO FINCO LTD 8.125% 15/06/21 144A	205,706	198,219	0.11
USD	202,000	CLEAR CHAN WLD 7.625% 15/3/20 WI-B	210,403	197,959	0.11
USD	176,000	DIEBOLD INC 8.5% 15/04/24 WI	176,237	186,999	0.11
USD	180,000	FREEPORT-MCMORAN 6.7500% 01/02/22	168,760	186,299	0.11
USD	175,000	RSI HOME PROD INC 6.5% 15/3/23 144A	175,563	183,312	0.10
USD	175,000	BUILD MAT CORP 5.375% 15/11/24 144A	175,000	182,927	0.10
USD	175,000	GROUP 1 AUTO 5% 01/06/22	173,208	180,249	0.10
USD	175,000	ITALICS MERGER 7.125% 15/07/23 144A	175,000	179,593	0.10
USD	160,000	MGM RESORTS INTL 6.625% 15/12/21	168,363	175,599	0.10
USD	164,000	UNITED RENTALS 5.5% 15/07/25	154,314	173,839	0.10
USD	167,000	CLEAR CHAN WLD 6.5% 15/11/22 WI	175,874	168,252	0.10
USD	165,000	ASHTON WOODS USA 6.875% 15/2/21 144	160,279	168,093	0.10
USD	139,000	SPRINT NEXTEL CORP 11.5% 15/11/21	120,235	167,842	0.09

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	165,000	AMERICAN AIRLINES 4.625% 1/3/20 144	165,000	167,680	0.09
USD	163,000	CENTURY COMMUNIT 5.8750% 15/07/25	163,039	163,814	0.09
USD	159,000	CALLON PETROLEUM 6.1250% 01/10/24	161,668	163,769	0.09
USD	177,000	FERRELLGAS LP 6.75% 15/06/23	176,120	162,397	0.09
USD	150,000	ALLY FINANCIAL INC 5.125% 30/09/24	147,483	162,187	0.09
USD	150,000	CITGO HOLDING 10.75% 15/02/20 144A	144,601	160,874	0.09
USD	159,000	TENET HEALTHCARE 8.125% 1/4/22	162,952	160,589	0.09
USD	150,000	HCA HLDG 6.25% 15/02/21	159,938	158,999	0.09
USD	168,000	CALPINE CORP 5.75% 15/01/25	167,073	158,759	0.09
USD	153,000	FELCOR LODGING LP 5.625% 01/03/23	155,797	157,207	0.09
USD	174,000	RITE AID CORP 6.125% 01/04/23 144A	171,343	156,683	0.09
USD	165,000	ALBERTSONS COS 6.6250% 15/06/24 WI	168,569	156,337	0.09
USD	150,000	AMKOR TECHNO INC 6.375% 01/10/22	158,250	154,799	0.09
USD	150,000	SPRINGLEAF FIN CORP 5.25% 15/12/19	150,000	154,313	0.09
USD	145,000	CERIDIAN CORP 11% 15/03/21 144A	144,062	151,367	0.09
USD	200,000	FRONTIER COMM 10.5% 15/09/22	181,543	151,250	0.09
USD	140,000	MGM RESORTS INTL 6% 15/03/23	141,198	151,200	0.09
USD	150,000	NATIONSTAR MORT/CAP 6.5% 01/08/18	150,000	150,150	0.08
USD	133,000	POST HLDGS 8% 15/07/25 144A	147,218	149,625	0.08
USD	149,000	CENTURYLINK INC 6.75% 01/12/23 W	150,430	146,020	0.08
USD	219,000	FRONTIER COMM 7.625% 15/04/24	201,669	145,088	0.08
USD	136,000	FIRST DATA CORP 7% 01/12/23 144A	139,886	143,820	0.08
USD	135,000	AIRXCEL INC 8.5% 15/02/22 144A	136,742	143,100	0.08
USD	138,000	REYNOLDS GRP ISS 5.125% 15/7/23 144	138,875	142,830	0.08
USD	125,000	SPRINT CAPITAL 8.75% 15/03/32	149,223	142,344	0.08
USD	158,000	HEXION US FIN 6.625% 15/04/20 WI	157,714	141,805	0.08
USD	185,000	REVLON CONSUMER 5.75% 15/02/21	185,242	139,675	0.08
USD	125,000	ENERGY TRANSFER EQ 7.5% 15/10/20	125,469	137,500	0.08
USD	135,000	LEVEL 3 FIN INC 5.375% 15/08/22 WI	134,156	136,728	0.08
USD	133,000	US AIRWAY 12-2C PTT 5.45% 03/06/18	134,663	134,038	0.08
USD	129,000	WILDHORSE RESO 6.8750% 01/02/25	128,286	131,903	0.07
USD	131,000	L BRANDS 6.75% 01/07/36	129,022	130,345	0.07
USD	133,000	CALPINE CORP 5.25% 01/06/26 144A	133,105	130,341	0.07
USD	120,000	DIAMOND 1/2 FIN 5.45% 15/06/23 144A	129,562	129,606	0.07
USD	132,000	CLEAR CHANNEL WORL 7.625% 15/3/20 A	137,610	129,195	0.07
USD	124,000	WHITING PETROLEUM 5.75% 15/03/21	112,666	127,255	0.07
USD	125,000	LIFEPOINT HOSPI 5.5% 01/12/21	128,969	126,563	0.07
USD	118,000	CORTES NP ACQ 9.25% 15/10/24 144A	118,165	125,965	0.07
USD	125,000	WILLIAM LYON HOM 5.75% 15/04/19	125,625	125,625	0.07
USD	125,000	LEVEL 3 COMM 5.75% 01/12/22 WI	126,955	125,506	0.07
USD	119,000	LADDER CAP FIN 5.25% 15/03/22 144A	119,600	122,719	0.07
USD	122,000	ASHTON WOODS 6.7500% 01/08/25 144A	122,035	121,848	0.07
USD	115,000	SCIENTIFIC GAMES INTL 7% 1/1/22 144	119,200	121,181	0.07
USD	163,000	WINDSTREAM CORP 7.75% 01/10/21	166,222	120,620	0.07
USD	115,000	REGAL ENTERTAINMENT 5.75% 15/06/23	112,383	118,881	0.07
USD	114,000	AVIS BUDGET CAR 6.375% 1/4/24 144A	114,570	118,845	0.07
USD	116,000	XERIUM TECHNO 9.5% 15/08/21	114,410	117,450	0.07
USD	120,000	UNIVISION COMM 5.125% 15/02/25 144A	118,640	117,000	0.07
USD	110,000	CHARTER COMM 4.908% 23/07/25	110,699	116,882	0.07
USD	139,000	EP ENERGY/EVER 9.375% 01/05/20	129,693	116,760	0.07
USD	112,000	LIVE NATION ENT 5.375% 15/06/22 144	113,400	115,780	0.07
USD	99,000	KB HOME 7.625% 15/05/23	100,145	113,355	0.06
USD	111,000	CARRIZO OIL&GAS INC 7.5% 15/09/20	113,263	113,081	0.06
USD	196,000	CHS/COMM HEALTH 6.875% 01/02/22 WI	195,652	112,700	0.06
USD	111,000	CHANGE HEALTH/FIN 5.75% 01/03/25 14	111,000	111,000	0.06
USD	109,000	L BRANDS 6.875% 01/11/35	111,735	110,090	0.06
USD	113,000	TENET HEALTHCARE 6.75% 15/06/23	112,460	109,610	0.06
USD	105,000	CCO HDGS LLC 5.75% 15/02/26 144A	105,000	109,069	0.06
USD	115,000	COMPRESSCO PART 7.25% 15/08/22	106,154	108,388	0.06
USD	100,000	WESTERN DIGITAL 7.375% 01/04/23 144	100,431	107,875	0.06

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	106,000	NUSTAR LOGISTICS 7.65% 15/04/18	120,133	107,723	0.06
USD	107,000	WEEKLEY HOMES LLC 6% 01/02/23	101,955	107,000	0.06
USD	97,000	DIAMOND 1/2 FIN 7.125% 15/06/24 144	100,916	106,202	0.06
USD	95,000	OWENS-BROCKWAY 6.375% 15/08/25 144A	95,000	106,163	0.06
USD	107,000	NAVIENT CORP 5.875% 25/10/24	104,867	105,930	0.06
USD	100,000	ENSEMBLE S MERGER 9% 30/09/23 144A	100,460	105,750	0.06
USD	112,000	CBL & ASSOCIATES LP 5.25% 01/12/23	106,281	105,709	0.06
USD	104,000	DENBURY RESOURCES 9% 15/05/21 144A	100,744	105,560	0.06
USD	100,000	DYNEGY INC 7.375% 01/11/22 WI	101,244	105,500	0.06
USD	100,000	HUNT COS INC 9.625% 01/03/21 144A	102,750	105,375	0.06
USD	98,000	EXTERRAN NRG SO 8.125% 01/05/25 144	98,700	105,350	0.06
USD	100,000	DISH DBS CORP 7.75% 01/07/26	102,460	105,125	0.06
USD	100,000	JDA ESC / BOND 7.375% 15/10/24 144	101,750	104,750	0.06
USD	148,000	IHEART COM 10.625% 15/03/23	147,108	104,340	0.06
USD	100,000	DANA HOLDING CO 6% 15/09/23	105,583	104,250	0.06
USD	100,000	DIAMOND 1 FIN/2 5.875% 15/06/21 144	104,625	103,750	0.06
USD	125,000	WEATHERFORD INTL 6.8% 15/06/37	94,147	103,750	0.06
USD	100,000	HRG GROUP 7.75% 15/01/22	98,883	103,750	0.06
USD	100,000	NEXSTAR BROAD 6.125% 15/02/22 144A	100,482	103,500	0.06
USD	97,000	BEAZER HOMES USA 6.7500% 15/03/25	97,000	102,214	0.06
USD	100,000	TRANSDIGM INC 6% 15/07/22	99,250	102,000	0.06
USD	98,000	BUILDERS FIRSTS 5.625% 1/09/24 144A	98,736	101,989	0.06
USD	123,000	MATTEL INC 5.4500% 01/11/41	99,938	101,783	0.06
USD	100,000	LAREDO PETROLEUM 5.625% 15/01/22	81,000	101,000	0.06
USD	95,000	TENET HEALTHCARE 6% 01/10/20	103,161	100,444	0.06
USD	78,000	DIAMOND 1/2 FIN 8.35% 15/07/46 144A	77,938	100,414	0.06
USD	100,000	CATERPILLAR FIN 2.25% 01/12/19 MTN	99,920	100,149	0.06
USD	91,000	MERITAGE HOMES 7.1500% 15/04/20	101,010	98,963	0.06
USD	86,000	WPX ENERGY INC 8.25% 01/08/23	86,347	97,610	0.06
USD	89,000	ALTA MESA HLDGS 7.8750% 15/12/24 WI	90,064	97,566	0.06
USD	93,000	FIRST DATA CORP 5.75% 15/01/24 144A	92,989	96,255	0.05
USD	94,000	TARGA RESOURCES 5.125% 1/02/25	96,139	96,233	0.05
USD	92,000	BWAY HDGS CO 5.5% 15/04/24 144A	92,000	95,680	0.05
USD	93,000	GENESIS ENERGY 6.5000% 01/10/25	93,000	94,395	0.05
USD	87,000	CHENIERE CORP 5.875% 31/03/25 WI	87,000	94,286	0.05
USD	89,000	DOLLAR TREE INC 5.75% 01/03/23	90,104	93,228	0.05
USD	122,000	PETSMART INC 5.875% 01/06/25 144A	118,610	92,720	0.05
USD	91,000	SM ENERGY CO 6.125% 15/11/22	73,769	92,706	0.05
USD	89,000	PDC ENERGY INC 6.1250% 15/09/24	90,186	92,115	0.05
USD	91,000	RIVERS PITTS/FIN 6.125% 15/08/21 14	92,965	90,318	0.05
USD	84,000	TRIUMPH GROUP 7.7500% 15/08/25 144A	84,000	89,145	0.05
USD	81,000	FREEPORT-MCMORAN 6.8750% 15/02/23	68,850	88,290	0.05
USD	86,000	OASIS PETROLEUM 6.875% 15/03/22	86,041	88,258	0.05
USD	85,000	WILLIAM LYON INC 5.8750% 31/01/25	84,445	86,806	0.05
USD	88,000	TRIUMPH GROUP 5.25% 01/06/22	85,188	86,240	0.05
USD	74,000	WESTERN DIGITAL 10.5% 01/04/24	74,088	85,748	0.05
USD	82,000	FLEX ACQUISITION 6.875% 15/01/25 14	82,650	84,919	0.05
USD	82,000	HOLOGIC INC 5.25% 15/07/22 144A	83,154	84,870	0.05
USD	100,000	SANCHEZ ENERY CORP 6.125% 15/1/23	84,663	84,500	0.05
USD	113,000	CHS COMMUNITY 7.125% 15/07/20	120,866	84,468	0.05
USD	90,000	RR DONNELLEY 6% 01/04/24	87,525	84,263	0.05
USD	81,000	GENESIS ENERGY LP 6.75% 01/08/22	80,040	84,038	0.05
USD	87,000	HDTFS INC 6.25% 15/10/22	79,780	83,955	0.05
USD	125,000	FRONTIER COMM 9% 15/08/31	99,075	83,438	0.05
USD	75,000	PRIME SECSRVC 9.25% 15/05/23 144A	78,038	83,063	0.05
USD	80,000	BK OF AMERICA CORP 3.95% 21/4/25 L	82,480	82,685	0.05
USD	100,000	CALIFORNIA RES 8% 15/12/22 144A	78,593	82,500	0.05
USD	75,000	MATCH GRP 6.375% 01/06/24	75,531	81,281	0.05
USD	90,000	ALBERTSONS COS 5.7500% 15/03/25 WI	90,000	81,180	0.05
USD	75,000	MGM RESORTS INTL 6.75% 01/10/20	81,188	81,000	0.05

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	MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25	75,000	80,250	0.05
USD	75,000	DONNELLEY FIN 8.25% 15/10/24 WI	75,000	80,250	0.05
USD	150,000	EP ENERGY/EVER 6.375% 15/06/23	96,225	80,250	0.05
USD	75,000	ELDORADO RES INC 7% 01/08/23 WI	76,950	80,156	0.05
USD	78,000	DYNEGY INC 6.75% 01/11/19	79,870	80,145	0.05
USD	77,000	TEMPUR SEALY INTL 5.625% 15/10/23	78,008	80,080	0.05
USD	75,000	AT & T INC 5.45% 01/03/47	78,709	80,075	0.05
USD	75,000	FBM FINANCE INC 8.25% 15/08/21 144A	75,000	79,688	0.05
USD	75,000	MPT OPER PARTNER 6.375% 01/03/24	75,000	79,313	0.04
USD	75,000	ALERIS INTL INC 9.5% 01/04/21 144A	78,000	79,125	0.04
USD	75,000	FELCOR LODGING LP 6% 01/06/25	75,000	79,125	0.04
USD	75,000	CENTURY COMM 6.875% 15/05/22	75,565	78,750	0.04
USD	75,000	COGENT COM 5.375% 01/03/22 144A	75,000	78,750	0.04
USD	80,000	BROADCOM CORP 3.875% 15/01/27 144A	82,494	78,673	0.04
USD	75,000	NCR CORP 6.375% 15/12/23	78,313	78,563	0.04
USD	150,000	MURRAY ENERGY 11.25% 15/04/21 144A	108,125	78,000	0.04
USD	78,000	ULTRA RESOURCES 7.125% 15/04/25 144	78,087	77,805	0.04
USD	75,000	NEXSTAR ESCROW 5.625% 01/08/24 144A	75,000	77,741	0.04
USD	73,000	SOUTHWESTERN ENE 7.5000% 01/04/26	73,055	77,563	0.04
USD	75,000	SPEEDWAY MOTORSP 5.125% 01/02/23	75,000	77,438	0.04
USD	75,000	CPG MERGER SUB 8% 01/10/21 144A	79,125	77,438	0.04
USD	73,000	NAVIENT CORP 6.625% 26/07/21	73,000	77,015	0.04
USD	73,000	RADIAN GROUP INC 5.25% 15/06/20	73,000	76,924	0.04
USD	70,000	CARRIZO OIL&GAS 8.2500% 15/07/25	71,828	76,913	0.04
USD	75,000	CINEMARK USA 5.125% 15/12/22	75,188	76,688	0.04
USD	75,000	LENNAR CORP 4.125% 15/01/22	75,000	76,500	0.04
USD	75,000	HARLAND CLARKE 6.875% 01/03/20 144A	76,379	76,500	0.04
USD	75,000	CALPINE CORP 5.875% 15/01/24 144A	80,250	76,313	0.04
USD	75,000	ICAHN ENTS FIN 5.875% 01/02/22	72,307	76,235	0.04
USD	71,000	DYNEGY INC 7.625% 01/11/24 WI	68,338	76,148	0.04
USD	75,000	TEMPO ACQUISITION 6.75% 01/06/25 14	75,500	76,125	0.04
USD	75,000	CONTINENTAL RESOURCES 5% 15/09/22	65,844	76,125	0.04
USD	70,000	BALL CORP 5.25% 01/07/25	70,000	76,125	0.04
USD	73,000	HEALTHSOUTH CORP 5.75% 15/09/25	73,000	75,920	0.04
USD	74,000	T-MOBILE USA INC 4% 15/04/22	74,000	75,896	0.04
USD	74,000	JBS USA LLC 7.25% 01/06/21 144A	77,845	75,203	0.04
USD	69,000	DYNEGY INC 8% 15/01/25 144A	67,719	74,693	0.04
USD	75,000	RANGE RESOURCES 5.0000% 15/03/23 WI	74,313	74,625	0.04
USD	72,000	DAVITA INC 5.75% 15/08/22	76,721	74,070	0.04
USD	75,000	REALOGY GROUP 4.875% 01/06/23 144A	74,452	74,063	0.04
USD	75,000	SOUTHWESTERN ENERGY 4.1% 15/03/22	63,813	73,875	0.04
USD	70,000	BAT CAPITAL C 4.5400% 15/08/47 144A	70,000	73,619	0.04
USD	71,000	ISTAR INC 6% 01/04/22	71,000	73,485	0.04
USD	74,000	CCO HDG LLC/CAP 5.125% 01/05/27 144	74,370	72,890	0.04
USD	66,000	ALLY FINANCIAL INC 8% 15/03/20	78,540	72,765	0.04
USD	70,000	UNIVISION COMM 6.75% 15/09/22 144A	73,199	72,713	0.04
USD	71,000	HEALTHSOUTH CORP 5.75% 01/11/24	69,769	72,686	0.04
USD	71,000	SPRINT CORP 7.125% 15/06/24 WI	73,243	72,243	0.04
USD	71,000	NUSTAR LOGISTICS 4.8% 01/09/20	64,772	72,065	0.04
USD	75,000	ASP AMC MERGER SUB 8% 15/05/25 144A	75,000	72,000	0.04
USD	67,000	DISH DBS CORP 7.875% 01/09/19	75,829	71,690	0.04
USD	75,000	CSVC ACQUISIT 7.7500% 15/06/25 144A	75,000	71,625	0.04
USD	75,000	CALPINE CORP 5.5% 01/02/24	75,000	71,438	0.04
USD	72,000	DAE FUNDING 5.0000% 01/08/24 144A	72,000	71,100	0.04
USD	70,000	MATTEL INC 6.7500% 31/12/25 144A	71,140	70,942	0.04
USD	75,000	RADIATE HOLDCO/FIN 6.625% 15/02/25	74,906	70,875	0.04
USD	83,000	GENWORTH HDGS INC 4.9% 15/08/23	67,782	70,758	0.04
USD	69,000	CCO HDGS LLC/CAP 5.125% 15/02/23	72,019	70,553	0.04
USD	70,000	CROWNROCK LP/ 5.6250% 15/10/25 144A	70,050	70,350	0.04
USD	70,000	NOBLE ENERGY INC 3.8500% 15/01/28	69,782	70,165	0.04

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	77,000	COMM SALES&LEAS 7.125% 15/12/24 144	77,378	70,070	0.04
USD	68,000	CALPINE CORP 6% 15/01/22 144A	71,513	70,040	0.04
USD	66,000	NOVELIS CORP 6.25% 15/08/24 144A	68,095	68,805	0.04
USD	65,000	HCA INC 5.875% 15/02/26	65,363	68,738	0.04
USD	65,000	SUNOCO LP/FIN 6.375% 01/04/23 WI	65,000	68,494	0.04
USD	68,000	POST HOLDINGS 5.6250% 15/01/28 144A	68,000	68,360	0.04
USD	72,000	ROWAN COMPANIES 4.875% 01/06/22	51,210	67,860	0.04
USD	66,000	NOVELIS CORP 5.875% 30/09/26 144A	66,110	67,568	0.04
USD	64,000	MERITOR INC 6.25% 15/02/24	64,672	67,360	0.04
USD	65,000	CHARTER COMM OP 5.3750% 01/05/47 WI	65,204	66,999	0.04
USD	64,000	GOODYEAR TIRE&RUBBER 5% 31/05/26	64,000	65,990	0.04
USD	65,000	CITGO PETROLEUM 6.25% 15/08/22 144A	68,338	65,488	0.04
USD	62,000	BOISE CASCADE CO 5.625% 1/9/24 144A	62,000	65,410	0.04
USD	50,000	GMAC 8% 01/11/31	58,500	64,875	0.04
USD	58,000	BILL BARRETT 8.7500% 15/06/25	58,000	64,090	0.04
USD	61,000	NAVIENT CORP 6.5% 15/06/22	62,790	64,020	0.04
USD	64,000	CLEVELAND-CLI 4.8750% 15/01/24 144A	63,655	63,840	0.04
USD	63,000	GULFPORT ENERGY 6.3750% 15/05/25	63,000	63,315	0.04
USD	61,000	PILGRIM'S PRI 5.75% 15/03/25 144A	61,000	63,059	0.04
USD	62,000	QEP RESOURCES 5.6250% 01/03/26	62,000	62,853	0.04
USD	62,000	MENS WEARHOUSE 7% 01/07/22	61,280	62,391	0.04
USD	59,000	HUGHES SATELLITE 6.625% 01/08/26	58,617	61,803	0.03
USD	75,000	HEXION 2 US FIN 13.75% 1/2/22 144A	74,688	61,500	0.03
USD	59,000	AMERICAN AIRLINES 5.5% 1/10/19 144A	59,116	60,623	0.03
USD	55,000	KINDER MORGAN INC 5.55% 01/06/45	54,396	60,131	0.03
USD	60,000	HESS CORP 4.3% 01/04/27	59,827	60,105	0.03
USD	60,000	TARGA RES PRT 5.0000% 15/01/28 144A	60,000	59,850	0.03
USD	75,000	GENON ENERGY INC 9.5% 15/10/18	78,150	59,625	0.03
USD	58,000	TEMPUR SEALY INTL 5.5% 15/6/26	58,159	59,462	0.03
USD	62,000	CLIFFS NATURAL RES 5.75% 01/03/25 1	59,585	58,978	0.03
USD	58,000	IRON MOUNTAIN 4.375% 01/06/21 144A	58,000	58,863	0.03
USD	60,000	SM ENERGY CO 5.625% 01/06/25	60,000	58,200	0.03
USD	86,000	HEXION INC 7.875% 15/02/23	54,153	58,050	0.03
USD	57,000	NUSTAR LOGISTICS 5.625% 28/04/27	57,000	57,998	0.03
USD	96,000	WINDSTREAM SR 6.3750% 01/08/23 144A	83,726	57,600	0.03
USD	55,000	T-MOBILE USA 6.625% 01/04/23	58,141	57,338	0.03
USD	50,000	MANITOWOC FOOD 9.5% 15/02/24	50,000	56,938	0.03
USD	50,000	MERITAGE HOMES CORP 7% 01/04/22	52,250	56,250	0.03
USD	50,000	SOLERA LLC/FIN 10.5% 01/03/24 144A	52,125	56,249	0.03
USD	55,000	MERITAGE HOMES 5.1250% 06/06/27	55,095	55,963	0.03
USD	54,000	LENNAR CORP 4.7500% 29/11/27 144A	54,000	55,609	0.03
USD	50,000	NOBLE ENERGY INC 5.25% 15/11/43	52,707	55,278	0.03
USD	53,000	CALATLANTIC GROU 5.0000% 15/06/27	53,000	54,988	0.03
USD	57,000	WINDSTREAM SR 8.6250% 31/10/25 144A	57,020	54,863	0.03
USD	50,000	STANDARDAERO AVIAT 10% 15/07/23 144	49,325	54,750	0.03
USD	50,000	MGIC INVESTMENT CORP 5.75% 15/08/23	50,000	54,688	0.03
USD	50,000	JACK OHIO FIN 10.25% 15/11/22 144	50,000	54,625	0.03
USD	50,000	TERRAFORM POWER 6.125% 15/06/25 144	38,875	54,500	0.03
USD	56,000	WINDSTREAM SR 8.6250% 31/10/25 REGS	60,162	54,040	0.03
USD	53,000	CCO HDGS LLC/CAP 5.25% 15/03/21	54,623	53,894	0.03
USD	50,000	CLOUD PEAK ENERGY 12% 01/11/21	50,531	53,875	0.03
USD	50,000	US CONCRETE INC 6.375% 01/06/24	50,000	53,625	0.03
USD	53,000	BEAZER HOMES 5.8750% 15/10/27 144A	52,959	53,265	0.03
USD	50,000	BEACON ROOF 6.375% 01/10/23	50,000	53,188	0.03
USD	45,000	CHARTER COMM 6.484% 23/10/45 WI	45,000	53,175	0.03
USD	50,000	K HOVNANIAN ENT 8% 01/11/19 144A	50,000	53,125	0.03
USD	50,000	ALLIANCE RES OP/FIN 7.5% 1/05/25 14	50,000	53,125	0.03
USD	50,000	MIDCONTINENT COM 6.875% 15/08/23 14	50,917	53,063	0.03
USD	54,000	DAE FUNDING 4.5000% 01/08/22 144A	54,100	53,055	0.03
USD	50,000	CUMBERLAND FARMS 6.75% 01/05/25 144	51,083	53,000	0.03

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	CHOBANI LLC/FIN 7.5% 15/04/25 144A	50,000	53,000	0.03
USD	50,000	CENTRAL GARDEN PET 6.125% 15/11/23	50,000	52,875	0.03
USD	53,000	IRON MOUNTAIN 5.2500% 15/03/28 144A	53,000	52,852	0.03
USD	50,000	SS&C TECH HOLD 5.875% 15/07/23	50,000	52,750	0.03
USD	45,000	APPLE INC 4.65% 23/02/46	48,456	52,636	0.03
USD	50,000	SPRINT NEXTEL 9% 15/11/18 144A	55,406	52,630	0.03
USD	50,000	CBS RADIO INC 7.25% 01/11/24 144A	50,625	52,625	0.03
USD	50,000	PARSLEY ENERGY 6.25% 01/06/24 144A	50,500	52,625	0.03
USD	50,000	AV HOMES INC 6.6250% 15/05/22 WI	50,000	52,563	0.03
USD	52,000	GRIFFON CORP 5.2500% 01/03/22 144@	52,599	52,520	0.03
USD	50,000	BRAND ENERGY 8.5000% 15/07/25 144A	50,813	52,500	0.03
USD	55,000	HEXION INC 10% 15/04/20	55,000	52,250	0.03
USD	50,000	H&E EQUIPMENT 5.6250% 01/09/25 144A	52,500	52,250	0.03
USD	50,000	MULTI-COLOR 6.125% 01/12/22 144A	50,000	52,188	0.03
USD	50,000	NAVISTAR INTL 6.6250% 01/11/25 144A	50,250	52,169	0.03
USD	50,000	BLUE RACER MID 6.125% 15/11/22 144A	49,988	52,125	0.03
USD	50,000	COVEY PARK ENERG 7.5% 15/05/25 144A	50,250	52,110	0.03
USD	50,000	CHESAPEAKE ENERGY 6.875% 15/11/20	46,354	52,000	0.03
USD	50,000	RANGE RESOURCES 5.7500% 01/06/21 WI	41,500	51,875	0.03
USD	50,000	PRESTIGE BRANDS 6.375% 01/03/24 144	50,000	51,813	0.03
USD	50,000	BMC EAST LLC 5.5% 01/10/24 144A	50,000	51,750	0.03
USD	50,000	WERNER LP/INC 8.7500% 15/07/25 144A	50,000	51,625	0.03
USD	50,000	SM ENERGY CO 6.75% 15/09/26	50,167	51,500	0.03
USD	50,000	PBF LOGIST LP/FIN 6.875% 15/5/23 WI	50,000	51,500	0.03
USD	50,000	GEO GROUP INC 6% 15/04/26	50,000	51,375	0.03
USD	50,000	WHITING PETROLEUM 5% 15/03/19	50,375	51,275	0.03
USD	50,000	GRAY TELE INC 5.875% 15/07/26 144A	50,500	51,250	0.03
USD	50,000	HECLA MINING CO 6.875% 01/05/21	46,844	51,250	0.03
USD	50,000	ICAHN ENTER/FIN 6.2500% 01/02/22 WI	50,000	51,219	0.03
USD	50,000	RHP HOTEL/RHP FIN 5% 15/04/23	50,000	51,125	0.03
USD	50,000	SABRA HEALTH 5.5% 01/02/21	49,750	51,063	0.03
USD	50,000	ARUBA INV 8.75% 15/02/23 144A	50,000	51,031	0.03
USD	50,000	ZAYO GRP LLC/CAP 5.75% 15/01/27	52,063	51,000	0.03
USD	50,000	WAVEDIVISION ESC 8.125% 1/09/20 144	53,000	51,000	0.03
USD	50,000	RANGE RESOURCES 5.8750% 01/07/22 WI	46,625	51,000	0.03
USD	47,000	TESORO LOGISTICS 6.375% 01/05/24	47,405	50,995	0.03
USD	50,000	RESOLUTE ENERGY CORP 8.5% 1/5/20	50,938	50,875	0.03
USD	50,000	TITAN INTL IN 6.5000% 30/11/23 144A	50,000	50,875	0.03
USD	50,000	POST HLDGS 5.75% 01/03/27 144A	52,750	50,875	0.03
USD	50,000	GIBRALTAR STEEL 6.25% 01/02/21	52,063	50,875	0.03
USD	50,000	GOLDEN NUGGET 6.7500% 15/10/24 144A	50,000	50,875	0.03
USD	51,000	WPX ENERGY INC 5.25% 15/09/24	50,235	50,824	0.03
USD	50,000	GENERAL MOTORS FIN 4% 06/10/26	49,931	50,819	0.03
USD	50,000	KINDRED HEALTH 6.375% 15/04/22	50,451	50,750	0.03
USD	50,000	HARLAND CLARKE 9.25% 01/03/21 144A	47,458	50,750	0.03
USD	50,000	TENET HEALTHCARE 5.5% 01/03/19	51,188	50,750	0.03
USD	47,000	CHESAPEAKE ENERGY 8% 15/12/22 WI	35,521	50,701	0.03
USD	50,000	MEDIACOM LLC/CORP 5.5% 15/04/21	50,750	50,625	0.03
USD	50,000	CONCHO RES/MIDLA 3.7500% 01/10/27	50,335	50,617	0.03
USD	50,000	USIS MERGER SUB 6.875% 01/05/25 144	50,000	50,500	0.03
USD	50,000	DAE FUNDING 4.0000% 01/08/20 144A	50,000	50,500	0.03
USD	50,000	CONTL AIRLINES 6.125% 29/04/18 12-3	52,688	50,441	0.03
USD	50,000	SUMMIT MID HDGS 5.75% 15/04/25	50,000	50,420	0.03
USD	50,000	NFP CORP 6.8750% 15/07/25 144A	50,000	50,375	0.03
USD	52,000	VERIZON COMMUN 4.672% 15/03/55	48,703	50,341	0.03
USD	50,000	ISTAR INC 5.2500% 15/09/22	50,219	50,313	0.03
USD	50,000	VALEANT PHARMA 7.25% 15/07/22 144A	45,104	50,250	0.03
USD	50,000	ORTHO-CLINICAL 6.625% 15/05/22 144A	45,875	50,250	0.03
USD	50,000	HRG GROUP 7.875% 15/07/19	52,250	50,100	0.03
USD	46,000	NRG ENERGY INC 7.25% 15/05/26	45,496	50,082	0.03

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	FREEMPORT-MCMORAN 2.375% 15/03/18	49,813	49,938	0.03
USD	50,000	HILLMAN GROUP INC 6.375% 15/7/22 14	42,750	49,875	0.03
USD	47,000	CIT GROUP INC 5% 15/08/22	49,291	49,820	0.03
USD	50,000	EW SCRIPPS CO 5.125% 15/05/25 144A	50,469	49,750	0.03
USD	50,000	DEAN FOODS 6.5% 15/03/23 144A	50,000	49,750	0.03
USD	50,000	NABORS INDUS 5% 15/09/20	49,844	49,750	0.03
USD	50,000	INTREPID AVIATION 6.875% 15/2/19 14	45,875	49,625	0.03
USD	50,000	SONIC AUTOMOTIVE 6.1250% 15/03/27	50,000	49,625	0.03
USD	46,000	OWENS-BROCKWAY 5.875% 15/08/23 144A	45,571	49,565	0.03
USD	50,000	ALERIS INTL INC 7.875% 01/11/20	41,500	49,500	0.03
USD	49,000	PARSLEY ENERGY 5.375% 15/01/25 144A	49,422	49,490	0.03
USD	50,000	TALAN ENERGY 10.5000% 15/01/26 144A	49,156	49,490	0.03
USD	50,000	CF INDUSTRIES INC 5.375% 15/03/44	44,104	49,375	0.03
USD	45,000	ENTERTAINMENT PROP 5.75% 15/08/22	49,818	49,049	0.03
USD	49,000	FREEMPORT-MCMORAN 5.45% 15/03/43	24,990	48,939	0.03
USD	50,000	AT&T 4.75% 15/05/46	45,607	48,850	0.03
USD	46,000	CRESCENT COMM 8.875% 15/10/21 144A	46,259	48,760	0.03
USD	50,000	PLAINS ALL AMER PIP 3.6% 01/11/24	48,732	48,665	0.03
USD	50,000	CNG HLDG INC 9.375% 15/05/20 144A	37,688	48,500	0.03
USD	50,000	ACRISURE LLC 7.0000% 15/11/25 144A	50,000	48,188	0.03
USD	80,000	WINDSTREAM SR 6.3750% 01/08/23 REGS	67,500	48,000	0.03
USD	46,000	CNH INDUSTRIAL CAP 4.375% 05/04/22	46,000	47,655	0.03
USD	44,000	TARGA RESOURCES 6.75% 15/03/24	44,000	47,190	0.03
USD	47,000	GULFPORT ENER 6.3750% 15/01/26 144A	47,160	47,118	0.03
USD	50,000	AHERN RENTALS 7.375% 15/5/23 144A	44,703	47,000	0.03
USD	46,000	VPI ESCROW CORP 6.375% 15/10/20 144	47,495	46,460	0.03
USD	40,000	ABBOTT LABORATORIES 4.9% 30/11/46	39,688	45,808	0.03
USD	50,000	INN MOUNTAIN GODS 8.75% 30/11/20 14	46,750	45,500	0.03
USD	44,000	BWAY HDGS CO 7.25% 15/04/25 144a	44,440	45,430	0.03
USD	45,000	VERIZON COMM 4.272% 15/01/36	44,570	44,730	0.03
USD	43,000	BEAZER HOMES USA 5.75% 15/06/19	41,710	44,505	0.03
USD	44,000	LIFEPPOINT HEALTH 5.875% 01/12/23	44,333	44,440	0.03
USD	40,000	DIAMOND 1/2 FIN 6.02% 15/06/26 144	44,237	44,080	0.02
USD	40,000	ABBVIE INC 4.45% 14/05/46	39,731	43,430	0.02
USD	50,000	CENTURYTEL INC 7.6% 15/09/39 P	48,813	43,000	0.02
USD	43,000	CENTURYLINK INC 7.5% 01/04/24 Y	43,197	42,893	0.02
USD	42,000	CONTINENTAL RES 4.5% 15/04/23	37,695	42,840	0.02
USD	44,000	SEAGATE HDD CAY 4.875% 01/06/27	34,473	42,045	0.02
USD	50,000	WEATHFORD BERMUDA 7% 15/03/38	47,750	42,000	0.02
USD	50,000	ENDO 5.75% 15/01/22 144A	45,969	41,625	0.02
USD	40,000	DISCOVERY COMMUN 5.0000% 20/09/37	40,379	41,411	0.02
USD	35,000	MICROSOFT CORP 4.5% 06/02/57	34,897	41,387	0.02
USD	40,000	MPLX LP 4.125% 01/03/27	40,086	40,943	0.02
USD	39,000	STARWOOD PROP T 5.0000% 15/12/21 WI	39,000	40,463	0.02
USD	40,000	AT&T INC 3.9000% 14/08/27	39,931	40,238	0.02
USD	50,000	RRI ENERGY INC 7.875% 15/06/17	45,875	40,000	0.02
USD	41,000	CCO HOLDINGS 5.0000% 01/02/28 144A	41,000	39,924	0.02
USD	39,000	PARSLEY ENER 5.6250% 15/10/27 144A	39,000	39,878	0.02
USD	31,000	EL PASO CORP 7.75% 15/01/32	29,591	39,859	0.02
USD	50,000	CLOUD PEAK ENERGY 6.375% 15/03/24	30,188	39,750	0.02
USD	39,000	CENTURYLINK INC 6.45% 15/06/21	39,731	39,390	0.02
USD	41,000	CHESAPEAKE ENERGY 8% 15/06/27 144A	41,000	39,360	0.02
USD	39,000	SBA COMMUNICA 4.0000% 01/10/22 144A	39,000	39,049	0.02
USD	43,000	CHS/COMM HEALTH 6.25% 31/03/23	43,753	38,700	0.02
USD	41,000	CBL&ASSOCIATES LP 5.95% 15/12/26	40,412	38,119	0.02
USD	50,000	NORTHERN OIL AND GAS 8% 01/06/20	47,500	37,750	0.02
USD	37,000	SM ENERGY CO 6.5% 15/11/21	35,058	37,463	0.02
USD	50,000	HEXION US FINANCE 9% 15/11/20	46,215	37,375	0.02
USD	37,000	DAVITA HEALTHCARE 5.125% 15/07/24	36,584	37,370	0.02
USD	37,000	GULFPORT ENERGY 6.0000% 15/10/24	37,000	37,000	0.02

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	40,000	VERIZON COMM 4.125% 15/08/46	34,870	36,911	0.02
USD	35,000	DISCOVERY COMMUN 5.2000% 20/09/47	34,958	36,491	0.02
USD	36,000	DISH DBS CORP 5.875% 15/07/22	37,035	36,180	0.02
USD	35,000	EP ENERGY/EVER 8% 29/11/24 144A	35,000	36,138	0.02
USD	50,000	FRONTIER COMM 8.75% 15/04/22	41,500	35,985	0.02
USD	35,000	WHITING PETRO 6.6250% 15/01/26 144A	35,170	35,700	0.02
USD	37,000	JBS USA LLC 5.75% 15/06/25 144A	36,019	35,613	0.02
USD	33,000	REYNOLDS GRP ISS 7% 15/07/24 144A	33,000	35,310	0.02
USD	34,000	PARSLEY ENERGY 5.25% 15/08/25 144A	34,140	34,085	0.02
USD	30,000	ENERGY TRANSF PARTN 6.5% 01/02/42	35,345	33,942	0.02
USD	30,000	ANHEUSER BUSCH IN 4.7% 01/02/36	33,483	33,516	0.02
USD	31,000	T-MOBILE USA INC 6.5% 15/01/24	33,054	32,860	0.02
USD	32,000	US AIRWAYS GROUP 6.125% 01/06/18	33,600	32,440	0.02
USD	31,000	INFOR US INC 5.75% 15/08/20 144A	30,866	31,853	0.02
USD	31,000	OASIS PETROLEUM 6.5% 01/11/21	28,404	31,659	0.02
USD	30,000	SLM CORP 4.875% 17/06/19 MTN	30,600	30,507	0.02
USD	27,000	BEAZER HOMES USA 8.75% 15/03/22 WI	27,000	29,765	0.02
USD	50,000	JC PENNEY CORP INC 6.375% 15/10/36	44,188	29,750	0.02
USD	25,000	CHARTER COMM 6.484% 23/10/45 144A	25,000	29,542	0.02
USD	465,000	AVAYA INC 10.5% 01/03/21 144A	420,825	29,063	0.02
USD	25,000	WILLIAMS COS 7.875% 01/09/21	20,729	28,875	0.02
USD	27,000	SPRINT CORP 7.25% 15/09/21	29,498	28,586	0.02
USD	25,000	IPAYMENT INC 10.75% 15/04/24 144A	24,500	28,250	0.02
USD	25,000	CLOUD CRANE LLC 10.125% 01/08/24 14	25,000	28,188	0.02
USD	20,000	FANNIE MAE 5.6250% 15/07/37	27,935	27,868	0.02
USD	25,000	ALCOA INC 5.95% 01/02/37	25,625	27,188	0.02
USD	25,000	ALLY FINANCIAL INC 5.75% 20/11/25	24,737	27,125	0.02
USD	25,000	QORVO INC 6.75% 01/12/23	27,219	26,938	0.02
USD	25,000	UNITED RENTALS 5.875% 15/09/26	26,156	26,750	0.02
USD	25,000	GATEWAY CASINO 8.25% 01/03/24 144A	25,000	26,750	0.02
USD	25,000	VERSUM MATERIALS 5.5% 30/09/24 144A	25,000	26,750	0.02
USD	25,000	SEALED AIR CORP 5.125% 1/12/24 144A	25,000	26,750	0.02
USD	25,000	JACOBS ENTERT 7.875% 01/02/24 144A	25,000	26,750	0.02
USD	25,000	GREIF INC 7.75% 01/08/19	28,625	26,688	0.02
USD	25,000	EXTRACTION OI 7.3750% 15/05/24 144A	25,000	26,688	0.02
USD	25,000	INCEPTION MRGR 8.625% 15/11/24 144A	25,120	26,688	0.02
USD	25,000	BLUELINE RENTAL 9.25% 15/03/24 144A	25,000	26,688	0.02
USD	25,000	VALVOLINE FINCO 5.5000% 15/07/24 WI	25,000	26,563	0.02
USD	25,000	MERCER INTL INC 6.5000% 01/02/24	25,094	26,563	0.02
USD	25,000	MGM RESORTS INTL 8.625% 01/02/19	28,438	26,500	0.01
USD	25,000	KOPPERS INC 6% 15/02/25 144A	25,000	26,500	0.01
USD	25,000	NCI BUILDING SYS 8.25% 15/01/23 144	25,000	26,500	0.01
USD	25,000	SPECTRUM BRANDS 6.125% 15/12/24	25,000	26,469	0.01
USD	25,000	SCOTTS MIRACLE 6% 15/10/23	25,000	26,469	0.01
USD	25,000	PINNACLE FOODS 5.875% 15/01/24 WI	25,000	26,438	0.01
USD	25,000	XPO LOGISTICS 6.125% 01/09/23 144A	25,375	26,438	0.01
USD	25,000	VENATOR FIN S 5.7500% 15/07/25 144A	25,000	26,375	0.01
USD	25,000	VHF PARENT LL 6.7500% 15/06/22 144A	25,000	26,313	0.01
USD	25,000	ANIXTER INC 5.125% 01/10/21	25,000	26,313	0.01
USD	25,000	WR GRACE & CO 5.125% 01/10/21 144A	25,000	26,281	0.01
USD	25,000	TENNANT CO 5.625% 01/05/25 144A	25,000	26,250	0.01
USD	25,000	MSCI INC 4.75% 01/08/26 144A	25,000	26,250	0.01
USD	25,000	GREAT LAKES DRED 8.0000% 15/05/22	25,000	26,156	0.01
USD	25,000	ELDORADO RESORTS 6.0000% 01/04/25	26,375	26,125	0.01
USD	25,000	WEIGHT WATCHE 8.6250% 01/12/25 144A	25,000	26,125	0.01
USD	25,000	US STEEL CORP 6.8750% 15/08/25	25,000	26,095	0.01
USD	25,000	LITHIA MOTORS 5.2500% 01/08/25 144A	25,000	26,063	0.01
USD	25,000	FIRST CASH FIN 5.375% 01/06/24 144A	25,000	26,063	0.01
USD	25,000	ASBURY AUTO 6% 15/12/24	26,063	26,030	0.01
USD	25,000	INTL LEASE FIN CORP 5.875% 01/04/19	26,813	26,019	0.01

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	25,000	PEABODY SEC FIN 6.375% 31/03/25 144	25,000	26,000	0.01
USD	25,000	SHEA HOMES LP 6.125% 01/04/25 144A	25,000	26,000	0.01
USD	25,000	SUMMIT MAT LLC 6.125% 15/07/23	25,500	26,000	0.01
USD	25,000	CHESAPEAKE ENERGY 6.625% 15/08/20	24,146	26,000	0.01
USD	25,000	HARLAND CLARKE 8.375% 15/08/22 144A	25,000	25,961	0.01
USD	25,000	SHEA HOMES LP 5.875% 01/04/23 144A	25,000	25,938	0.01
USD	25,000	NATHAN'S FAMO 6.6250% 01/11/25 144A	25,000	25,938	0.01
USD	25,000	PEABODY SEC FIN 6% 31/03/22 144A	25,000	25,938	0.01
USD	25,000	WMG ACQUISITION 5% 01/08/23 144A	25,000	25,875	0.01
USD	25,000	PIONEER HLD/F 9.0000% 01/11/22 144A	25,000	25,844	0.01
USD	25,000	ASCEND LEARNING LLC 6.875% 01/08/25	25,000	25,813	0.01
USD	25,000	HESS INF / FI 5.6250% 15/02/26 144A	25,000	25,813	0.01
USD	25,000	GROUP 1 AUTO 5.25% 15/12/23 144A	25,000	25,813	0.01
USD	25,000	KFC HOLD PIZZA 5% 01/06/24 144A	25,000	25,781	0.01
USD	25,000	PENSKE AUTO 5.75% 01/10/22	25,063	25,781	0.01
USD	25,000	CCO HDGS LLC/CAP 5.375% 01/05/25 14	25,625	25,758	0.01
USD	25,000	ANTERO MIDSTREA 5.3750% 15/09/24 WI	25,000	25,750	0.01
USD	25,000	ECLIPSE RESOURCES 8.875% 15/07/23	23,563	25,656	0.01
USD	25,000	MOHEGAN TRIBAL 7.875% 15/10/24 144A	24,818	25,625	0.01
USD	25,000	RADIAN GROUP INC 4.5000% 01/10/24	25,000	25,613	0.01
USD	25,000	NGPL PIPECO L 4.3750% 15/08/22 144A	25,000	25,531	0.01
USD	25,000	SM ENERGY CO 6.5% 01/01/23	23,281	25,500	0.01
USD	25,000	GANNETT CO 4.875% 15/09/21 144A	24,633	25,500	0.01
USD	25,000	BILL BARRETT CORP 7% 15/10/22	19,750	25,469	0.01
USD	25,000	PENSKE AUTO GRP 3.7500% 15/08/20	25,000	25,469	0.01
USD	25,000	CHENIERE ENER 5.2500% 01/10/25 144A	25,594	25,438	0.01
USD	25,000	PQ CORP 5.7500% 15/12/25 144A	25,000	25,438	0.01
USD	25,000	FIVE PT OP CO 7.8750% 15/11/25 144A	25,000	25,438	0.01
USD	25,000	B&G FOODS INC 5.25% 01/04/25	25,125	25,429	0.01
USD	25,000	MRT MID PART/FIN 7.25% 15/02/21	21,938	25,375	0.01
USD	25,000	NRG YIELD OPERAT 5.0000% 15/09/26	25,000	25,375	0.01
USD	25,000	CD&R WATERWOR 6.1250% 15/08/25 144A	25,000	25,375	0.01
USD	25,000	CLEAR CHAN WLD 6.5% 15/11/22 wi	25,969	25,375	0.01
USD	25,000	MATCH GROUP 1 5.0000% 15/12/27 144A	24,757	25,375	0.01
USD	25,000	CRC ESCROW IS 5.2500% 15/10/25 144A	24,969	25,258	0.01
USD	25,000	MATTHEWS INTE 5.2500% 01/12/25 144A	25,000	25,250	0.01
USD	25,000	NATIONSTAR MORT 6.5% 01/06/22	20,875	25,250	0.01
USD	25,000	DELEK LOG PART 6.75% 15/05/25 144A	24,811	25,250	0.01
USD	28,000	CHS/COMM HEALTH 5.125% 01/08/21	27,720	25,200	0.01
USD	25,000	ALLIANCE DATA SYST 5.375% 1/08/22 1	24,349	25,188	0.01
USD	25,000	JELD-WEN INC 4.6250% 15/12/25 144A	25,000	25,188	0.01
USD	25,000	STATION CASIN 5.0000% 01/10/25 144A	25,000	25,125	0.01
USD	25,000	BOOZ ALLEN HAM 5.125% 01/05/25 144A	25,203	25,063	0.01
USD	25,000	SIRIUS XM RAD 3.8750% 01/08/22 144A	25,250	25,063	0.01
USD	25,000	CEQUEL COM HLD 5.125% 15/12/21 144A	22,938	25,063	0.01
USD	25,000	ICAHN ENTER/F 6.3750% 15/12/25 144A	25,000	25,003	0.01
USD	25,000	TPC GROUP INC 8.75% 15/12/20 144A	19,594	25,000	0.01
USD	25,000	UNIVERSAL HOSPITAL 7.625% 15/08/20	23,479	25,000	0.01
USD	25,000	GRAY TELE INC 5.125% 15/10/24 144A	25,188	24,938	0.01
USD	25,000	FRONTIER COMMS 8.125% 01/10/18	26,469	24,904	0.01
USD	25,000	WEEKLEY HM LL 6.6250% 15/08/25 144A	24,433	24,875	0.01
USD	25,000	WILLIAMS CIE 3.7% 15/01/23	17,375	24,875	0.01
USD	25,000	FLEXI VAN LSG 7.875% 15/08/18 144A	25,438	24,875	0.01
USD	25,000	ASSUREDPARTNE 7.0000% 15/08/25 144A	25,000	24,875	0.01
USD	25,000	DCP MIDSTREAM OP 2.7000% 01/04/19	24,875	24,844	0.01
USD	25,000	SINCLAIR TELE 5.125% 15/02/27 144A	25,000	24,781	0.01
USD	25,000	EVERI PAYMENT 7.5000% 15/12/25 144A	25,000	24,781	0.01
USD	25,000	COEUR MINING INC 5.8750% 01/06/24	25,000	24,688	0.01
USD	25,000	ROSE ROCK MID 5.625% 15/07/22	12,500	24,688	0.01
USD	25,000	CALFRAC HLDG 7.5% 01/12/20 144A	22,313	24,625	0.01

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	25,000	AMC ENTMNT HOLDI 5.8750% 15/11/26	26,188	24,625	0.01
USD	25,000	SOTHEBY'S 4.8750% 15/12/25 144A	25,000	24,594	0.01
USD	25,000	TOWNSQUARE MEDIA 6.5% 01/04/23 144A	25,375	24,438	0.01
USD	25,000	TENET HEALTHC 4.6250% 15/07/24 144A	25,000	24,313	0.01
USD	25,000	EMBARQ CORP 7.995% 01/06/36	26,188	24,313	0.01
USD	25,000	EXELA INTER 10.0000% 15/07/23 144A	25,000	24,313	0.01
USD	25,000	NABORS INDUS 4.625% 15/09/21	24,813	23,813	0.01
USD	23,000	CCO HLDGS LLC/CAP 5.5% 01/05/26 144	23,000	23,575	0.01
USD	25,000	RADIO ONE INC 9.25% 15/02/20 144A	24,563	23,500	0.01
USD	25,000	NATIONAL CINEMED 5.75% 15/08/26 WI	25,000	23,438	0.01
USD	25,000	NWH ESCROW CORP 7.5% 01/08/21 144a	23,500	23,000	0.01
USD	21,000	HERC RENTALS INC 7.5% 01/06/22 144A	21,630	22,628	0.01
USD	25,000	CARDTRONICS INC 5.5% 01/05/25 144A	25,000	22,500	0.01
USD	25,000	ENDO FIN LLC/FINCO 7.25% 15/01/22 1	24,813	21,625	0.01
USD	25,000	VIACOM INC 4.375% 15/03/43	19,758	21,622	0.01
USD	25,000	FERRELLGAS 8.6250% 15/06/20	24,000	21,313	0.01
USD	21,000	UNITED RENTAL NA 4.8750% 15/01/28	21,053	21,105	0.01
USD	25,000	DENBURY RESOURCES 6.375% 15/08/21	20,875	18,875	0.01
USD	25,000	JONES ENERGY 9.25% 15/03/23	23,000	18,563	0.01
USD	16,000	ADVANCED MICRO 7.5% 15/08/22	14,840	17,560	0.01
USD	17,000	RITE AID CORP 6.75% 15/06/21 WI	17,746	16,830	0.01
USD	16,000	ULTRA RESOURCES 6.875% 15/04/22 144	16,000	16,040	0.01
USD	14,000	RADIAN GROUP INC 7% 15/03/21	14,000	15,698	0.01
USD	25,000	SUNGARD AVAIL 8.75% 01/04/22 144A	17,438	15,438	0.01
USD	15,000	ROWAN COMPANIES INC 7.375% 15/6/25	15,000	15,263	0.01
USD	100,000	APPVION INC 9% 01/06/20 144A	52,625	15,000	0.01
USD	13,000	INVENTIV HEALTH 7.5% 01/10/24 144A	13,000	14,040	0.01
USD	13,000	WPX ENERGY INC 6% 15/01/22	13,136	13,585	0.01
USD	13,000	PILGRIM'S PRI 5.8750% 30/09/27 144A	13,000	13,390	0.01
USD	14,000	HERTZ CORP 5.5% 15/10/24 144A	11,843	12,600	0.01
USD	12,000	HALCON RES CORP 6.75% 15/02/25 144A	12,000	12,480	0.01
USD	12,000	SCIENTIFIC GA 5.0000% 15/10/25 144A	12,000	12,030	0.01
USD	11,000	ENDEAVOR ENER 5.7500% 30/01/28 144A	11,000	11,297	0.01
USD	11,000	ENDEAVOR ENER 5.5000% 30/01/26 144A	11,000	11,193	0.01
USD	10,000	BEAZER HOMES USA 7.25% 01/02/23	9,570	10,400	0.01
USD	10,000	RITE AID CORP 7.7% 15/02/27	9,733	8,500	0.00
USD	10,000	IHEART COMMUNICATIONS 9% 01/03/21	8,850	7,150	0.00
USD	10,000	PUERTO RICO AQUE&SE 5.125% 01/07/37	7,125	6,163	0.00
USD	25,000	CLAIRE'S ST ESC 8.875% 15/3/19	15,594	6,000	0.00
USD	5,000	WINDSTREAM CORP 7.75% 15/10/20	4,850	4,225	0.00
USD	5,000	PUERTO RICO CMWLTH 6% 01/07/44	3,700	3,181	0.00
USD	125,000	TEXAS COMPETIT ESC 11.5% 1/10/20 14	1,267	938	0.00
USD	25,000	SEVENTY SEVEN ENER ESC 6.5% 15/7/22	0	0	0.00
USD	51,000	SANDRIDGE ENERGY ESC 7.5% 15/03/21	0	0	0.00
USD	200,000	MIDWAY GAMES CV 9.25% ESC 01/06/21	0	0	0.00
USD	540,000	AVETA INC ESCROW I 0.0000% 01/04/19	0	0	0.00
USD	50,000	PEABODY ENERGY ESC 10% 15/3/22 144A	0	0	0.00
USD	75,000	AVETA INC ESCW 144 0.0000% 01/04/19	0	0	0.00
USD	150,000	MIDWAY GAMES CV 10.75% 01/10/20 DFT	0	0	0.00
			50,407,637	50,730,028	28.71
TBA取引					
USD	735,000	FNCL MBS 30YR TBA 4.0000% 11/01/18	767,752	768,763	0.43
USD	645,000	FGLMC MBS 30YR TBA 4.0000% 11/01/18	673,521	674,630	0.38
USD	495,000	FGLMC MBS 30YR TBA 3.5000% 11/01/18	507,166	508,303	0.29
USD	430,000	FNCL MBS 30YR TBA 3.5000% 11/01/18	440,528	441,556	0.25
USD	220,000	FGCI MBS 15YR TBA 3.0000% 17/01/18	224,263	224,056	0.13
USD	205,000	FNCL MBS 15YR TBA 3.0000% 17/01/18	208,972	208,844	0.12
USD	155,000	G2SF MBS 30YR TBA 3.5000% 22/01/18	160,464	160,280	0.09
USD	115,000	FNCL MBS 30YR TBA 3.0000% 11/01/18	114,659	114,964	0.07

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	110,000	FGLMC MBS 30YR TBA 3.0000% 11/01/18	109,683	109,966	0.06
USD	50,000	FNCL MBS 30YR TBA 4.5000% 11/01/18	53,281	53,188	0.03
			3,260,289	3,264,550	1.85
短期国庫債券					
USD	400,000	TREASURY BILL 0% 24/05/18	395,944	397,694	0.23
			395,944	397,694	0.23
優先証券					
--	14,675	GMAC CAP TST I PFD FRN 15/02/40	371,073	380,523	0.21
--	895	HOLDCO PREF STOCK	76,792	53,700	0.03
--	733	COWEN GROUP PFD 8.25% 15/10/21	18,325	19,681	0.01
--	146	PEABODY ENE CV PFD 8.5% 31/10/65	3,525	10,293	0.01
			469,715	464,197	0.26
国債					
USD	2,475,000	TSY INFL IX N/ 0.1250% 15/04/22 CPI	2,511,862	2,490,682	1.40
USD	1,050,000	US TREAS NOTE 0.125% 15/07/26 (CPI)	1,027,848	1,054,493	0.60
USD	315,000	US TREAS NOTE 3.875% 15/04/29 (CPI)	662,285	643,236	0.36
USD	550,000	US TREAS NOTE 0.625% 15/01/26 (CPI)	571,600	579,252	0.33
USD	330,000	US TREAS NOTE 2.5% 15/01/29 (CPI)	458,143	459,044	0.26
USD	420,000	US TREASURY N/B 2.1250% 31/12/22	417,631	418,031	0.24
USD	265,000	US TREAS NOTE 1.625% 15/02/26	250,744	250,052	0.14
USD	250,000	US TREASURY N/B 2.2500% 31/12/24	248,077	248,438	0.14
USD	100,000	US TREAS NOTE 0.625% 15/02/43 (CPI)	99,987	104,654	0.06
USD	40,000	TSY INFL IX N/ 0.3750% 15/07/27 CPI	39,432	40,063	0.02
USD	30,000	US TREAS NOTE 0.875% 15/02/47 (CPI)	29,628	31,761	0.02
USD	10,000	US TREAS NOTE 3.875% 15/08/40	11,863	12,033	0.01
			6,329,100	6,331,739	3.58
ワラント					
--	1,138	MIDSTATES PETROLEUM CO INC WTS 2020	70,676	1,252	0.00
--	583	HALCON RESOURCES WTS 2020	2,506	437	0.00
--	99	SANDRIDGE ENERGY INC WTS 2022	0	130	0.00
--	41	SANDRIDGE ENERGY INC WTS 2022	0	51	0.00
--	41	JACK COOPER ENT WTS 29/10/27	0	0	0.00
			73,182	1,870	0.00
		合計: アメリカ	136,817,843	134,566,134	76.16
ベネズエラ					
その他債券					
USD	950,000	PETROLEOS DE VENEZ 6% 28/10/22	294,500	175,750	0.10
			294,500	175,750	0.10
普通社債(固定金利債)					
USD	60,000	PETROLEOS VENEZUELA 5.375% 12/04/27	18,600	13,950	0.01
			18,600	13,950	0.01
		合計: ベネズエラ	313,100	189,700	0.11
組入資産合計			169,463,275	165,223,831	93.52

⁽¹⁾ 額面価格は発行通貨建て表示

財務書類に関する注記

2017年12月31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

2017年12月31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)
ZAR	151,200,000	USD	11,043,993	2018年2月23日	1,109,798
ZAR	44,100,000	USD	3,038,508	2018年1月25日	520,684
TRY	30,900,000	USD	7,801,533	2018年1月25日	331,392
INR	657,000,000	USD	10,009,217	2018年1月25日	247,153
TRY	28,200,000	USD	7,146,658	2018年2月23日	215,471
ZAR	17,100,000	USD	1,241,125	2018年1月25日	138,970
INR	456,000,000	USD	7,015,492	2018年2月23日	77,104
USD	1,220,407	MXN	23,000,000	2018年1月25日	59,412
USD	1,169,808	MXN	22,000,000	2018年1月25日	59,291
USD	678,773	MXN	13,000,000	2018年1月25日	22,559
USD	519,855	MXN	10,000,000	2018年1月25日	15,075
USD	544,252	ZAR	6,700,000	2018年1月25日	3,513
USD	357,865	INR	23,000,000	2018年1月25日	(1,186)
USD	388,681	INR	25,000,000	2018年1月25日	(1,591)
USD	390,070	TRY	1,500,000	2018年1月25日	(4,732)
USD	361,347	TRY	1,400,000	2018年1月25日	(7,135)
USD	988,646	INR	64,000,000	2018年1月25日	(10,453)
USD	540,212	ZAR	6,900,000	2018年1月25日	(16,669)
USD	1,107,163	TRY	4,300,000	2018年1月25日	(24,602)
USD	950,874	ZAR	12,200,000	2018年1月25日	(33,755)
USD	693,651	ZAR	9,500,000	2018年1月25日	(73,069)
BRL	55,700,000	USD	16,873,163	2018年2月2日	(127,727)
MXN	81,000,000	USD	4,242,392	2018年2月23日	(173,857)
MXN	283,500,000	USD	14,676,571	2018年1月25日	(366,046)
JPY	707,883,445	USD	6,281,839	2018年1月10日	9,860
USD	63,341	JPY	7,111,422	2018年1月10日	135
USD	125,122	JPY	14,073,157	2018年1月10日	40
USD	7,412	JPY	836,730	2018年1月25日	(30)
USD	7,412	JPY	837,398	2018年1月10日	(30)
USD	13,305	JPY	1,501,900	2018年1月25日	(54)
USD	13,305	JPY	1,503,098	2018年1月10日	(54)
USD	39,557	JPY	4,476,210	2018年1月10日	(228)
USD	61,972	JPY	7,017,952	2018年1月10日	(404)
USD	61,972	JPY	7,012,901	2018年1月25日	(407)
JPY	681,246,326	USD	6,093,707	2018年1月25日	(34,080)
AUD	2,250,000	USD	1,693,242	2018年3月15日	63,378
RUB	114,000,000	USD	1,914,711	2018年3月15日	49,565
ZAR	4,442,684	USD	319,422	2018年3月22日	36,347
USD	579,066	MXN	10,805,840	2018年1月26日	33,717
USD	1,078,359	MXN	20,886,700	2018年3月15日	32,725
NZD	1,319,820	USD	908,927	2018年3月21日	28,923
INR	140,000,000	USD	2,147,206	2018年3月15日	24,881
SEK	11,274,202	EUR	1,130,551	2018年3月21日	18,484
TRY	2,600,000	USD	661,132	2018年3月15日	13,606
TRY	553,573	USD	134,689	2018年3月21日	8,709
NOK	5,400,000	USD	650,535	2018年3月15日	7,563
RUB	17,219,872	USD	290,312	2018年2月12日	7,521
RUB	17,219,872	USD	290,385	2018年2月12日	7,447

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)
CLP	77,142,684	USD	118,032	2018年1月11日	7,435
INR	22,875,800	USD	349,611	2018年2月2日	7,141
AUD	445,699	USD	341,469	2018年1月16日	6,555
USD	126,000	MXN	2,391,417	2018年3月21日	6,399
AUD	454,573	USD	348,561	2018年1月16日	6,392
TRY	397,065	USD	96,857	2018年3月21日	5,999
ZAR	656,777	USD	47,695	2018年1月18日	5,373
AUD	240,945	USD	183,030	2018年3月21日	5,076
SEK	6,070,487	EUR	612,889	2018年3月21日	4,956
PLN	1,707,333	EUR	403,453	2018年3月21日	4,761
PLN	1,695,097	EUR	400,651	2018年3月21日	4,619
AUD	175,012	USD	132,563	2018年3月21日	4,070
CAD	215,077	USD	167,686	2018年1月17日	3,972
ZAR	536,351	USD	39,000	2018年3月22日	3,951
ZAR	536,311	USD	39,000	2018年3月22日	3,948
INR	7,403,162	USD	111,864	2018年1月12日	3,878
INR	14,797,601	USD	226,957	2018年2月2日	3,815
PHP	5,910,953	USD	114,631	2018年1月26日	3,769
INR	9,093,375	USD	138,407	2018年1月25日	3,548
CLP	39,238,808	USD	60,326	2018年1月5日	3,469
SEK	5,173,000	EUR	522,926	2018年3月21日	3,442
USD	1,123,743	JPY	126,033,072	2018年1月12日	3,440
NZD	170,000	USD	117,492	2018年3月21日	3,308
KRW	146,739,016	USD	134,964	2018年1月16日	2,773
PLN	842,368	EUR	198,854	2018年3月21日	2,593
CLP	26,565,000	USD	40,690	2018年2月22日	2,492
CLP	24,892,956	USD	38,000	2018年1月16日	2,470
CLP	26,067,603	USD	39,941	2018年1月5日	2,440
USD	85,765	BRL	277,281	2018年2月2日	2,405
CLP	25,393,949	USD	39,000	2018年1月5日	2,286
USD	87,749	MXN	1,710,409	2018年3月21日	2,208
CLP	25,917,160	USD	40,000	2018年1月4日	2,134
CLP	23,788,700	USD	36,545	2018年1月16日	2,129
CAD	242,447	USD	191,431	2018年1月17日	2,071
AUD	84,416	USD	63,862	2018年3月21日	2,042
ZAR	236,581	USD	17,000	2018年3月22日	1,945
CNH	754,772	USD	113,518	2018年3月21日	1,686
USD	195,261	HKD	1,510,285	2018年3月27日	1,656
NZD	57,000	USD	38,930	2018年3月21日	1,573
ZAR	481,484	USD	37,000	2018年3月22日	1,557
USD	39,000	MXN	749,416	2018年3月21日	1,520
NZD	109,000	USD	75,952	2018年3月21日	1,501
GBP	280,859	USD	378,883	2018年3月21日	1,497
CLP	17,655,186	USD	27,229	2018年1月16日	1,474
HUF	146,182,733	EUR	469,791	2018年3月21日	1,454
TWD	2,541,805	USD	84,386	2018年1月23日	1,398
USD	161,000	HKD	1,245,077	2018年3月27日	1,392
INR	2,855,160	USD	43,161	2018年2月15日	1,293
ZAR	478,030	USD	37,000	2018年3月22日	1,281
USD	210,000	HKD	1,626,975	2018年5月11日	1,266
SEK	963,953	EUR	97,000	2018年3月21日	1,175
CNH	500,844	USD	75,294	2018年3月21日	1,151
CAD	51,480	USD	40,000	2018年3月21日	1,109
EUR	67,435	USD	79,994	2018年3月21日	1,106
USD	38,000	MXN	738,473	2018年3月21日	1,067
AUD	52,000	USD	39,538	2018年3月21日	1,058
AUD	50,000	USD	37,978	2018年3月21日	1,057
RUB	2,498,837	USD	42,282	2018年1月24日	1,037
INR	5,474,124	USD	84,217	2018年2月15日	1,015
CAD	48,850	USD	38,000	2018年3月21日	1,009
USD	212,895	JPY	23,752,167	2018年3月22日	1,002

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)
CAD	48,834	USD	38,000	2018年3月21日	996
USD	115,070	HKD	889,922	2018年3月27日	991
KRW	43,069,154	USD	39,455	2018年1月16日	972
RUB	2,252,925	USD	38,000	2018年2月12日	966
CAD	48,789	USD	38,000	2018年3月21日	960
USD	158,000	JPY	17,604,202	2018年3月22日	952
NZD	45,552	USD	31,421	2018年3月21日	948
PHP	5,910,953	USD	117,164	2018年3月22日	947
CAD	48,752	USD	38,000	2018年3月21日	931
IDR	2,350,882,193	USD	171,497	2018年2月20日	930
CAD	48,739	USD	38,000	2018年3月21日	920
NZD	55,000	USD	38,163	2018年3月21日	919
USD	304,102	HKD	2,365,093	2018年3月27日	919
CAD	47,457	USD	36,985	2018年3月21日	910
KRW	41,450,400	USD	38,000	2018年1月16日	908
ZAR	473,295	USD	37,000	2018年3月22日	901
CAD	48,711	USD	38,000	2018年3月21日	897
USD	38,000	MXN	742,178	2018年3月21日	882
CAD	48,662	USD	38,000	2018年3月21日	858
CAD	42,395	USD	33,000	2018年3月21日	854
USD	37,000	MXN	722,798	2018年3月21日	851
CLP	10,360,800	USD	16,000	2018年1月5日	845
CAD	51,147	USD	40,000	2018年3月21日	843
CAD	66,160	USD	52,000	2018年3月21日	831
TRY	64,946	USD	16,000	2018年3月21日	824
RUB	2,186,420	USD	36,999	2018年2月12日	816
USD	79,000	JPY	8,764,354	2018年3月22日	813
RUB	1,861,146	USD	31,421	2018年2月12日	769
USD	105,000	HKD	813,112	2018年3月27日	766
GBP	30,000	USD	39,866	2018年3月21日	764
USD	36,993	MXN	724,980	2018年3月21日	735
IDR	1,250,105,664	USD	91,288	2018年1月12日	721
EUR	33,000	GBP	28,787	2018年3月21日	698
NZD	54,000	USD	37,678	2018年3月21日	693
EUR	33,000	GBP	28,810	2018年3月21日	668
CAD	49,665	USD	39,000	2018年3月21日	659
CZK	5,033,004	EUR	195,958	2018年3月21日	655
IDR	1,242,830,767	USD	90,823	2018年1月12日	651
CAD	69,093	USD	54,536	2018年3月21日	636
THB	1,452,990	USD	44,000	2018年1月19日	636
BRL	267,092	USD	79,662	2018年2月2日	636
NZD	55,716	USD	38,965	2018年3月21日	626
EUR	69,078	JPY	9,242,776	2018年3月22日	626
EUR	33,000	GBP	28,861	2018年3月21日	598
SEK	316,671	EUR	31,689	2018年3月21日	598
USD	71,400	HKD	552,364	2018年3月27日	592
IDR	3,633,773,000	USD	266,777	2018年1月16日	523
HUF	10,066,080	EUR	32,000	2018年3月21日	521
TWD	2,118,853	USD	71,000	2018年1月23日	510
HUF	10,370,613	EUR	33,000	2018年3月21日	498
JPY	8,686,832	USD	77,000	2018年3月22日	496
USD	97,950	JPY	10,924,299	2018年3月22日	494
USD	83,203	JPY	9,273,213	2018年3月22日	477
USD	40,000	JPY	4,430,776	2018年3月22日	473
EUR	33,945	JPY	4,523,570	2018年3月22日	472
INR	2,522,598	USD	39,000	2018年1月8日	459
GBP	24,000	USD	32,051	2018年3月21日	453
CAD	20,591	USD	16,000	2018年3月21日	443
PHP	1,169,122	USD	23,000	2018年1月8日	438
EUR	33,127	USD	39,404	2018年3月21日	436
HUF	10,679,311	EUR	34,047	2018年3月21日	435

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)
EUR	32,000	USD	38,050	2018年3月21日	434
SEK	328,169	EUR	33,000	2018年3月21日	428
JPY	7,378,597	USD	65,164	2018年1月12日	424
EUR	33,000	GBP	28,992	2018年3月21日	421
AUD	21,000	USD	15,974	2018年3月21日	420
JPY	5,885,711	USD	51,898	2018年1月12日	420
USD	72,003	BRL	238,119	2018年2月2日	416
JPY	8,955,174	USD	79,477	2018年3月22日	412
EUR	32,429	USD	38,591	2018年3月21日	409
CAD	22,794	USD	17,792	2018年3月21日	409
TWD	1,315,600	USD	44,000	2018年1月23日	401
CAD	23,365	USD	18,262	2018年3月21日	396
JPY	8,451,598	USD	75,007	2018年3月22日	389
USD	13,686	MXN	265,930	2018年3月21日	386
BRL	129,098	USD	38,429	2018年2月2日	382
CAD	34,266	USD	27,000	2018年3月21日	363
JPY	8,447,677	USD	75,000	2018年3月22日	362
EUR	33,429	GBP	29,417	2018年3月21日	361
BRL	128,439	USD	38,258	2018年2月2日	355
INR	2,694,315	USD	41,791	2018年1月8日	353
HUF	10,329,402	EUR	33,000	2018年3月21日	338
EUR	66,591	GBP	58,895	2018年3月21日	319
EUR	33,000	GBP	29,071	2018年3月21日	314
NOK	633,968	EUR	64,000	2018年3月21日	308
PHP	863,090	USD	17,000	2018年1月5日	305
CHF	77,305	EUR	66,000	2018年3月21日	305
EUR	33,000	GBP	29,079	2018年3月21日	303
HUF	10,318,598	EUR	33,000	2018年3月21日	296
EUR	66,846	CHF	77,710	2018年3月21日	296
EUR	31,001	USD	36,991	2018年3月21日	292
EUR	33,000	USD	39,396	2018年3月21日	290
JPY	4,729,622	USD	41,759	2018年1月12日	282
CHF	37,672	EUR	32,052	2018年3月21日	281
INR	1,240,579	USD	19,035	2018年2月15日	280
EUR	31,012	USD	37,017	2018年3月21日	278
NOK	300,766	EUR	30,253	2018年3月21日	277
EUR	33,256	GBP	29,327	2018年3月21日	275
PHP	811,520	USD	16,000	2018年1月8日	269
USD	93,000	HKD	721,422	2018年9月19日	256
JPY	4,400,292	USD	39,000	2018年3月22日	255
INR	1,380,330	USD	21,352	2018年1月8日	239
INR	2,786,379	USD	43,149	2018年2月15日	235
CHF	17,558	USD	17,863	2018年3月21日	233
EUR	33,000	CHF	38,285	2018年3月21日	226
JPY	4,396,743	USD	39,000	2018年3月22日	224
JPY	4,209,311	USD	37,196	2018年1月12日	220
EUR	32,000	GBP	28,255	2018年3月21日	216
JPY	17,644,000	USD	156,626	2018年1月12日	210
CHF	41,862	EUR	35,710	2018年3月21日	201
EUR	33,000	GBP	29,156	2018年3月21日	199
SEK	227,855	EUR	23,000	2018年3月21日	192
EUR	33,385	GBP	29,505	2018年3月21日	190
NOK	341,541	EUR	34,462	2018年3月21日	186
JPY	4,169,773	USD	37,014	2018年3月22日	185
NOK	306,669	EUR	30,949	2018年3月21日	160
USD	37,013	BRL	122,593	2018年2月2日	158
EUR	33,000	CHF	38,361	2018年3月21日	148
USD	94,021	IDR	1,279,907,873	2018年2月20日	145
EUR	32,522	CHF	37,808	2018年3月21日	144
USD	113,000	JPY	12,650,576	2018年3月22日	144
USD	56,000	HKD	434,489	2018年9月19日	143

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)
EUR	33,000	GBP	29,200	2018年3月21日	140
NOK	326,711	EUR	33,000	2018年3月21日	137
IDR	1,541,006,531	USD	112,890	2018年2月20日	136
EUR	33,000	GBP	29,204	2018年3月21日	133
EUR	33,000	GBP	29,206	2018年3月21日	131
PHP	353,569	USD	6,962	2018年1月8日	125
CLP	25,917,160	USD	42,031	2018年1月22日	120
PHP	432,126	USD	8,529	2018年2月22日	115
PLN	36,562	EUR	8,629	2018年3月21日	115
INR	2,457,948	USD	38,256	2018年1月25日	115
NOK	326,498	EUR	33,000	2018年3月21日	111
JPY	3,851,342	USD	34,248	2018年3月22日	110
HKD	1,575,282	USD	201,804	2018年3月21日	109
NOK	6,264,995	EUR	634,899	2018年3月21日	107
GBP	22,230	USD	29,999	2018年3月21日	107
EUR	32,000	CHF	37,234	2018年3月21日	107
JPY	4,158,570	USD	37,000	2018年3月22日	99
EUR	33,000	NOK	324,782	2018年3月21日	98
INR	2,332,345	USD	36,312	2018年1月25日	97
EUR	34,572	CHF	40,247	2018年3月21日	95
EUR	33,000	GBP	29,234	2018年3月21日	94
GBP	12,886	USD	17,361	2018年3月21日	91
JPY	4,381,845	USD	39,000	2018年3月22日	91
JPY	4,157,844	USD	37,003	2018年3月22日	89
USD	39,000	JPY	4,362,072	2018年3月22日	86
CHF	38,581	EUR	33,000	2018年3月21日	79
USD	32,032	GBP	23,595	2018年3月21日	77
CHF	38,578	EUR	33,000	2018年3月21日	76
EUR	35,137	CHF	40,929	2018年3月21日	72
CHF	38,574	EUR	33,000	2018年3月21日	72
IDR	2,128,821,565	USD	156,628	2018年1月11日	71
CHF	38,253	EUR	32,727	2018年3月21日	68
NOK	147,890	EUR	14,935	2018年3月21日	65
EUR	6,912	NOK	67,687	2018年3月21日	63
JPY	4,293,168	USD	38,240	2018年3月22日	59
CHF	38,551	EUR	33,000	2018年3月21日	47
AUD	104,000	NZD	114,195	2018年3月21日	47
USD	164,353	CLP	101,061,160	2018年1月5日	46
JPY	5,272,836	USD	47,000	2018年3月22日	39
TWD	283,147	USD	9,541	2018年3月8日	39
INR	2,592,057	USD	40,264	2018年2月26日	36
CHF	40,148	EUR	34,378	2018年3月21日	36
INR	2,374,753	USD	37,001	2018年2月2日	33
EUR	13,000	USD	15,602	2018年3月21日	32
IDR	204,330,000	USD	15,000	2018年1月16日	31
USD	16,287	CHF	15,786	2018年3月21日	17
EUR	7,242	USD	8,695	2018年3月21日	14
IDR	356,451,544	USD	26,200	2018年1月19日	13
EUR	12,974	USD	15,595	2018年3月21日	9
USD	38,151	JPY	4,276,338	2018年3月22日	2
GBP	30,580	EUR	34,439	2018年3月21日	(1)
EUR	33,000	CHF	38,506	2018年3月21日	(2)
AUD	17,000	NZD	18,681	2018年3月21日	(3)
PHP	1,608,969	USD	32,192	2018年2月22日	(5)
USD	38,000	JPY	4,260,332	2018年3月22日	(7)
USD	38,000	JPY	4,260,940	2018年3月22日	(12)
IDR	878,571,552	USD	64,676	2018年1月12日	(13)
USD	36,983	CLP	22,748,354	2018年1月22日	(14)
JPY	4,312,625	EUR	32,001	2018年3月22日	(16)
GBP	7,832	EUR	8,834	2018年3月21日	(17)
EUR	8,076	HUF	2,511,819	2018年3月21日	(20)

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	36,993	CLP	22,758,420	2018年1月22日	(20)
EUR	7,601	HUF	2,364,746	2018年3月21日	(21)
USD	36,989	JPY	4,149,391	2018年3月22日	(27)
USD	37,455	AUD	48,012	2018年3月21日	(28)
JPY	4,368,429	USD	39,000	2018年3月22日	(29)
EUR	33,000	NOK	325,828	2018年3月21日	(29)
IDR	529,425,000	USD	39,000	2018年1月11日	(30)
USD	93,586	TWD	2,772,279	2018年2月2日	(30)
CLP	101,061,160	USD	164,391	2018年1月22日	(30)
GBP	11,912	EUR	13,442	2018年3月21日	(33)
EUR	98,410	CZK	2,521,264	2018年3月21日	(33)
GBP	30,981	USD	41,994	2018年3月21日	(34)
EUR	31,990	NOK	315,965	2018年3月21日	(41)
USD	39,233	GBP	29,000	2018年3月21日	(42)
JPY	7,990,157	USD	71,067	2018年1月12日	(43)
BRL	132,056	USD	39,745	2018年2月2日	(44)
CHF	76,965	EUR	66,000	2018年3月21日	(46)
CHF	77,213	EUR	66,215	2018年3月21日	(49)
GBP	58,569	EUR	66,000	2018年3月21日	(51)
USD	25,103	BRL	83,669	2018年2月2日	(51)
USD	6,958	CLP	4,309,840	2018年1月22日	(51)
JPY	11,203,500	USD	100,000	2018年3月22日	(53)
JPY	1,807,640	USD	16,182	2018年3月22日	(56)
USD	30,007	EUR	25,000	2018年3月21日	(58)
JPY	4,476,824	USD	40,000	2018年3月22日	(62)
USD	38,000	BRL	126,616	2018年2月2日	(65)
JPY	4,364,064	USD	39,000	2018年3月22日	(68)
EUR	18,991	NOK	188,007	2018年3月21日	(77)
USD	74,784	BRL	249,010	2018年2月2日	(77)
CZK	676,834	EUR	26,498	2018年3月21日	(88)
USD	16,179	EUR	13,526	2018年3月21日	(88)
USD	17,980	CHF	17,534	2018年3月21日	(92)
IDR	569,730,000	USD	41,882	2018年2月20日	(95)
PEN	637,228	USD	196,651	2018年1月16日	(97)
JPY	3,965,989	USD	35,477	2018年3月22日	(97)
USD	17,935	CHF	17,497	2018年3月21日	(100)
USD	37,547	NZD	52,981	2018年3月21日	(101)
NOK	314,798	EUR	32,000	2018年3月21日	(113)
USD	42,018	CLP	25,917,160	2018年1月4日	(116)
JPY	4,470,248	USD	40,000	2018年3月22日	(121)
USD	17,579	CAD	22,172	2018年3月21日	(125)
NOK	127,231	EUR	13,000	2018年3月21日	(126)
USD	37,538	NZD	53,007	2018年3月21日	(128)
EUR	30,994	HUF	9,653,258	2018年3月21日	(130)
JPY	4,434,259	EUR	33,000	2018年3月22日	(131)
USD	39,678	EUR	33,105	2018年3月21日	(135)
MXN	277,253	USD	14,006	2018年3月21日	(141)
USD	74,038	AUD	95,016	2018年3月21日	(141)
USD	36,988	CLP	22,830,208	2018年1月22日	(142)
EUR	30,994	SEK	306,100	2018年3月21日	(142)
EUR	44,817	HUF	13,946,883	2018年3月21日	(143)
USD	38,000	JPY	4,275,843	2018年3月22日	(145)
USD	95,124	BRL	316,912	2018年2月2日	(151)
EUR	19,008	SEK	188,432	2018年3月21日	(173)
EUR	12,893	SEK	128,282	2018年3月21日	(175)
USD	38,290	EUR	31,985	2018年3月21日	(175)
USD	37,312	AUD	48,020	2018年3月21日	(177)
JPY	4,351,698	USD	39,000	2018年3月22日	(178)
NOK	172,046	SEK	173,021	2018年3月21日	(178)
USD	533,317	JPY	60,018,540	2018年1月12日	(185)
MXN	435,850	USD	21,993	2018年3月21日	(196)

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)
JPY	4,461,060	USD	40,000	2018年3月22日	(203)
USD	14,680	PEN	48,265	2018年1月19日	(205)
USD	43,700	EUR	36,510	2018年3月21日	(208)
JPY	2,023,254	USD	18,262	2018年3月22日	(213)
USD	38,000	JPY	4,283,664	2018年3月22日	(215)
AUD	103,000	NZD	113,478	2018年3月21日	(224)
USD	19,629	PHP	992,660	2018年2月22日	(229)
CZK	1,608,390	EUR	63,000	2018年3月21日	(245)
USD	38,218	EUR	31,985	2018年3月21日	(247)
USD	8,990	CAD	11,569	2018年3月21日	(248)
HKD	495,017	USD	63,708	2018年3月27日	(251)
NOK	251,717	EUR	25,722	2018年3月21日	(252)
USD	37,014	ZAR	465,446	2018年3月22日	(259)
ARS	130,526	USD	6,816	2018年3月15日	(261)
NOK	313,556	EUR	32,000	2018年3月21日	(264)
NOK	318,278	EUR	32,491	2018年3月21日	(279)
USD	37,366	NZD	53,001	2018年3月21日	(296)
USD	15,000	TRY	59,050	2018年3月21日	(296)
USD	14,997	TRY	59,069	2018年3月21日	(303)
JPY	4,556,456	EUR	34,059	2018年3月22日	(316)
USD	38,000	JPY	4,294,988	2018年3月22日	(316)
USD	75,000	KRW	80,226,038	2018年2月2日	(327)
IDR	1,016,625,000	USD	75,000	2018年2月2日	(336)
USD	52,168	JPY	5,907,070	2018年1月12日	(339)
USD	15,953	AUD	20,872	2018年3月21日	(342)
ARS	146,276	USD	7,851	2018年1月31日	(346)
HKD	1,502,843	USD	193,000	2018年3月27日	(349)
EUR	42,374	HUF	13,244,841	2018年3月21日	(362)
NOK	322,614	EUR	33,000	2018年3月21日	(362)
USD	69,224	GBP	51,382	2018年3月21日	(365)
USD	48,977	TWD	1,458,311	2018年3月8日	(367)
USD	42,475	TWD	1,266,195	2018年3月8日	(368)
USD	12,340	NZD	17,893	2018年3月21日	(374)
ARS	127,725	USD	6,765	2018年3月22日	(375)
EUR	33,000	PLN	139,603	2018年3月21日	(376)
USD	13,569	TRY	53,946	2018年3月21日	(405)
USD	15,216	NZD	22,000	2018年3月21日	(416)
ARS	148,288	USD	8,116	2018年1月8日	(422)
USD	41,396	TWD	1,235,945	2018年3月8日	(423)
USD	47,364	INR	3,055,276	2018年1月8日	(426)
USD	37,011	ZAR	467,710	2018年3月22日	(443)
USD	53,782	CLP	33,347,533	2018年1月22日	(453)
USD	39,000	CAD	49,417	2018年3月21日	(462)
USD	15,915	AUD	21,000	2018年3月21日	(479)
GBP	29,404	EUR	33,516	2018年3月21日	(484)
USD	37,870	NZD	54,000	2018年3月21日	(502)
USD	36,155	CAD	45,925	2018年3月21日	(517)
MXN	729,242	USD	37,006	2018年3月21日	(536)
USD	14,546	TRY	58,228	2018年3月21日	(537)
EUR	58,528	NOK	581,915	2018年3月21日	(544)
USD	23,000	TRY	90,922	2018年3月21日	(553)
BRL	127,861	USD	39,000	2018年2月2日	(560)
BRL	127,795	USD	39,000	2018年2月2日	(580)
USD	36,978	CAD	47,045	2018年3月21日	(588)
BRL	181,667	USD	55,208	2018年2月2日	(593)
USD	40,000	CNH	265,960	2018年3月21日	(594)
EUR	94,388	SEK	933,594	2018年3月21日	(604)
USD	37,001	KRW	40,094,370	2018年1月22日	(638)
USD	38,000	CAD	48,394	2018年3月21日	(644)
USD	38,732	CNH	258,053	2018年3月21日	(655)
USD	38,000	CNH	253,334	2018年3月21日	(667)

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・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	30,808	TRY	121,512	2018年3月21日	(668)
JPY	8,779,507	USD	79,000	2018年3月22日	(678)
USD	70,371	INR	4,565,000	2018年2月15日	(706)
USD	69,226	INR	4,485,900	2018年2月2日	(732)
USD	77,349	CHF	75,762	2018年3月21日	(738)
USD	44,000	TWD	1,325,720	2018年1月23日	(742)
USD	38,965	CHF	38,526	2018年3月21日	(743)
USD	53,022	RUB	3,108,684	2018年2月12日	(745)
USD	36,989	TRY	145,698	2018年3月21日	(753)
ARS	166,333	USD	9,386	2018年1月8日	(756)
USD	31,000	TRY	122,616	2018年3月21日	(763)
USD	38,271	AUD	50,000	2018年3月21日	(763)
ARS	254,678	USD	13,845	2018年1月29日	(764)
USD	16,000	TRY	64,796	2018年3月21日	(785)
USD	22,635	AUD	30,000	2018年3月21日	(786)
USD	74,033	CLP	46,006,464	2018年1月22日	(790)
USD	16,000	TRY	64,816	2018年3月21日	(790)
GBP	59,070	EUR	67,205	2018年3月21日	(821)
ARS	300,185	USD	16,399	2018年1月8日	(824)
USD	37,000	CAD	47,376	2018年3月21日	(832)
ARS	365,583	USD	19,581	2018年2月1日	(832)
EUR	33,000	NZD	57,056	2018年3月21日	(857)
ARS	369,869	USD	19,853	2018年1月31日	(875)
USD	117,514	PHP	5,910,953	2018年1月26日	(886)
USD	91,832	TWD	2,740,000	2018年3月15日	(917)
USD	42,112	PHP	2,151,439	2018年2月22日	(927)
USD	38,000	RUB	2,251,500	2018年2月12日	(942)
USD	66,358	RUB	3,891,233	2018年2月12日	(944)
ARS	703,080	USD	37,000	2018年2月2日	(959)
USD	39,000	CAD	50,081	2018年3月21日	(992)
USD	160,874	SGD	216,055	2018年3月21日	(1,038)
USD	59,992	PEN	197,912	2018年1月16日	(1,054)
USD	39,430	NZD	57,000	2018年3月21日	(1,073)
USD	30,197	TRY	120,771	2018年3月21日	(1,088)
USD	77,519	EUR	65,398	2018年3月21日	(1,131)
ARS	393,336	USD	20,767	2018年3月27日	(1,139)
USD	47,024	PHP	2,407,880	2018年2月9日	(1,175)
MXN	715,842	USD	36,993	2018年3月21日	(1,192)
USD	37,382	ZAR	481,910	2018年3月22日	(1,209)
USD	81,601	NZD	116,544	2018年3月21日	(1,214)
USD	89,880	TWD	2,693,271	2018年3月8日	(1,251)
USD	39,196	NZD	57,000	2018年3月21日	(1,307)
ARS	419,157	USD	22,361	2018年3月15日	(1,313)
USD	11,271	ZAR	157,287	2018年3月22日	(1,324)
EUR	156,978	PLN	662,475	2018年3月21日	(1,329)
USD	41,449	NZD	60,240	2018年3月21日	(1,356)
ARS	587,981	USD	31,522	2018年2月1日	(1,368)
EUR	96,599	SEK	962,124	2018年3月21日	(1,433)
ARS	427,200	USD	22,826	2018年3月22日	(1,453)
USD	36,953	CLP	23,643,971	2018年1月16日	(1,486)
EUR	381,639	CHF	446,756	2018年3月21日	(1,497)
ARS	547,917	USD	29,269	2018年2月27日	(1,527)
MXN	749,083	USD	39,000	2018年3月21日	(1,536)
USD	15,000	ZAR	207,291	2018年3月22日	(1,600)
USD	44,904	PHP	2,324,250	2018年2月9日	(1,621)
USD	31,774	TRY	129,406	2018年3月21日	(1,747)
USD	208,912	CAD	263,816	2018年3月21日	(1,752)
MXN	1,456,888	USD	75,279	2018年1月26日	(1,753)
USD	95,000	CAD	121,164	2018年3月21日	(1,754)
USD	74,983	CAD	96,147	2018年3月21日	(1,793)
USD	184,118	TWD	5,509,390	2018年1月23日	(1,819)

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)
ARS	774,066	USD	41,272	2018年2月21日	(1,963)
NOK	1,447,582	EUR	148,411	2018年3月21日	(2,034)
USD	396,462	EUR	332,331	2018年1月31日	(2,048)
BRL	5,410,000	USD	1,628,586	2018年2月2日	(2,144)
MXN	1,412,957	USD	73,476	2018年1月26日	(2,168)
USD	204,513	CAD	259,015	2018年1月17日	(2,212)
USD	78,569	NZD	114,000	2018年3月21日	(2,438)
ARS	815,000	USD	43,864	2018年2月27日	(2,599)
USD	75,460	AUD	100,000	2018年3月21日	(2,610)
USD	76,000	CLP	48,367,920	2018年1月16日	(2,634)
CZK	6,775,583	EUR	266,744	2018年3月21日	(2,653)
BRL	362,392	USD	111,635	2018年2月2日	(2,688)
ARS	1,113,942	USD	60,556	2018年1月8日	(2,758)
USD	30,000	ZAR	410,662	2018年3月22日	(2,886)
ARS	747,609	USD	40,795	2018年2月28日	(2,961)
USD	258,395	EUR	217,475	2018年3月21日	(3,146)
USD	32,000	ZAR	443,936	2018年3月22日	(3,550)
MXN	1,377,480	USD	73,270	2018年1月26日	(3,752)
USD	38,474	ZAR	530,000	2018年3月15日	(4,010)
USD	38,000	ZAR	525,803	2018年3月22日	(4,106)
USD	171,715	KRW	187,419,312	2018年1月16日	(4,206)
ARS	1,735,000	USD	92,582	2018年2月15日	(4,211)
ARS	1,409,874	USD	77,036	2018年1月22日	(4,376)
USD	188,867	CAD	242,243	2018年1月17日	(4,473)
USD	758,413	JPY	85,520,607	2018年3月22日	(4,519)
USD	316,134	TWD	9,503,000	2018年1月23日	(4,585)
USD	206,029	AUD	269,977	2018年3月21日	(4,742)
USD	45,000	ZAR	626,130	2018年3月22日	(5,140)
USD	757,523	JPY	85,520,606	2018年3月22日	(5,409)
USD	373,488	TWD	11,232,653	2018年2月8日	(5,961)
NOK	6,284,631	EUR	641,936	2018年3月21日	(5,962)
JPY	60,003,240	USD	539,588	2018年1月12日	(6,222)
USD	341,564	AUD	445,449	2018年1月16日	(6,264)
USD	336,336	AUD	439,000	2018年1月16日	(6,457)
JPY	66,029,832	USD	593,783	2018年1月12日	(6,847)
USD	918,096	JPY	104,120,272	2018年1月12日	(7,424)
ARS	1,855,790	USD	100,776	2018年3月14日	(7,538)
ARS	1,898,360	USD	103,255	2018年3月15日	(7,928)
USD	538,919	TWD	16,195,075	2018年2月22日	(8,595)
USD	418,915	SEK	3,500,000	2018年3月15日	(8,740)
ARS	3,134,611	USD	170,544	2018年2月1日	(9,782)
USD	68,251	ZAR	966,549	2018年1月18日	(9,847)
JPY	126,033,072	USD	1,133,340	2018年1月12日	(13,038)
MXN	5,063,916	USD	267,743	2018年3月21日	(14,485)
USD	1,015,434	CHF	1,000,000	2018年3月15日	(14,756)
BRL	2,261,601	USD	696,595	2018年2月2日	(16,676)
USD	1,184,318	EUR	1,000,000	2018年3月15日	(17,828)
USD	1,630,134	SGD	2,200,000	2018年3月15日	(18,385)
USD	132,321	ZAR	1,922,219	2018年1月18日	(22,996)
USD	168,648	ZAR	2,440,519	2018年1月18日	(28,549)
USD	4,869,576	JPY	550,319,550	2018年2月13日	(29,701)
USD	1,675,279	ILS	5,900,000	2018年3月15日	(30,493)
USD	1,177,080	NZD	1,700,000	2018年3月15日	(30,995)
USD	5,263,834	JPY	594,000,000	2018年3月15日	(32,927)
USD	3,429,017	GBP	2,560,000	2018年3月15日	(37,320)
USD	1,740,365	PLN	6,200,000	2018年3月15日	(38,785)
USD	1,552,682	KRW	1,694,800,000	2018年3月15日	(39,666)
USD	3,745,873	CAD	4,800,000	2018年3月15日	(86,752)
					1,739,412

注記2 - 先物契約

2017年12月31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)
<i>買い持ちポジション</i>					
USD	3	FUT BRL CURRENCY	2018年2月	90,495	555
AUD	11	FUT AUST 10YR BOND 6%	2018年3月	1,109,382	(9,225)
EUR	16	FUT EURO BUXL 30YR 4%	2018年3月	3,137,461	(73,741)
USD	7	FUT MXN CURRENCY	2018年3月	175,735	(5,879)
USD	2	FUT NEW ZEALAND DOLLAR	2018年3月	141,860	3,784
				4,654,933	(84,506)
<i>売り持ちポジション</i>					
USD	(2)	FUT EURO FX CURRENCY	2018年3月	(301,888)	(5,150)
GBP	(8)	FUT LONG GILT 10YR 4%	2018年3月	(1,352,429)	(10,481)
AUD	(34)	FUT AUST 3YR BOND 6%	2018年3月	(2,949,493)	6,746
EUR	(20)	FUT EUR OAT	2018年3月	(3,714,080)	48,107
EUR	(79)	FUT EURO BOBL 5YR 6%	2018年3月	(12,442,322)	32,694
EUR	(5)	FUT EURO BUND 10YR 6%	2018年3月	(967,413)	8,377
EUR	(4)	FUT EURO SCHATZ 2YR 6%	2018年3月	(536,002)	742
USD	(11)	FUT US LONG BD 20YR 6%	2018年3月	(1,681,969)	4,920
USD	(9)	FUT US NOTE 10YR 6%	2018年3月	(1,115,719)	9,579
USD	(36)	FUT US NOTE 2YR 6%	2018年3月	(7,707,375)	7,673
USD	(47)	FUT US NOTE 5YR 6%	2018年3月	(5,457,508)	22,992
USD	(1)	FUT US ULTRA BOND 30YR 6%	2018年3月	(167,406)	1,346
USD	(38)	FUT US ULTRA NOTE 10YR 6%	2018年3月	(5,070,625)	16,043
JPY	(13)	FUT 10YR MINI JGB	2018年3月	(1,741,799)	462
USD	(6)	FUT 90 DAY EURODOLLAR	2018年12月	(1,467,825)	3,530
USD	(1)	FUT 90 DAY EURODOLLAR	2019年3月	(244,488)	1,388
USD	(2)	FUT 90 DAY EURODOLLAR	2018年9月	(489,800)	2,525
USD	(1)	FUT 90 DAY EURODOLLAR	2019年9月	(244,250)	1,313
USD	(1)	FUT 90DAY EURODOLLAR	2019年6月	(244,338)	1,367
GBP	(70)	FUT 90DAY STERLING 8	2018年3月	(11,752,443)	0
				(59,649,172)	154,173
				69,667	

注記3 - オプション契約

2017年12月31日現在、ファンドは以下の未決済オプション契約を有していた。

通貨	契約数	銘柄名	満期日	取得原価 (米ドル)	評価金額 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
<i>買い持ちポジション</i>						
USD	6	P FUT 0EM9 98	2018年6月15日	1,664	4,650	2,986
				1,664	4,650	2,986
				1,664	4,650	2,986

注記4 - 金利スワップ契約

2017年12月31日現在、ファンドは以下の未決済金利スワップ契約を有していた。

通貨	額面	銘柄名	満期日	経過利息 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
USD	380,000	Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (2.14286%)	2023年7月3日	0	2,427
USD	600,000	Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (2.56%)	2048年7月3日	0	(6,141)
USD	1,440,000	Receive Fixed (2.37750%) - Pay Floating (3M USD LIBOR)	2028年7月3日	0	(4,576)
USD	1,260,000	Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (2.346%)	2028年8月7日	0	8,103
USD	410,000	Receive Fixed (2.40%) - Pay Floating (3M USD LIBOR)	2027年8月31日	0	(2,549)
USD	4,720,000	Receive Fixed (1.855%) - Pay Floating (3M USD LIBOR)	2020年8月6日	0	(24,930)
USD	5,440,000	Receive Fixed (2.13895%) - Pay Floating (3M USD LIBOR)	2020年11月20日	0	(3,542)
USD	2,380,000	Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (2.275%)	2023年11月20日	0	3,747
USD	600,000	Receive Fixed (2.25%) - Pay Floating (3M USD LIBOR)	2028年3月21日	0	(7,811)
USD	240,000	Receive Fixed (2.00%) - Pay Floating (3M USD LIBOR)	2023年3月21日	0	(2,925)
USD	1,390,000	Receive Fixed (1.75%) - Pay Floating (3M USD LIBOR)	2020年3月23日	0	(9,079)
USD	80,000	Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (2.4315%)	2027年12月7日	(45)	(423)
SEK	19,010,000	Receive Fixed (0.05%) - Pay Floating (3M SEK-STIBOR)	2018年6月15日	1,162	5,207
SEK	14,490,000	Receive Fixed (-0.33%) - Pay Floating (3M SEK-STIBOR)	2018年9月17日	(1,269)	931
SEK	19,470,000	Receive Fixed (-0.10%) - Pay Floating (3M SEK-STIBOR)	2019年6月28日	0	1,171
SEK	6,260,000	Receive Floating (3M SEK-STIBOR) - Pay Fixed (2.00%)	2027年10月25日	0	(3,314)
SEK	4,260,000	Receive Floating (3M SEK-STIBOR) - Pay Fixed (2.00%)	2027年11月2日	0	(2,164)
SEK	230,000	Receive Fixed (0.50%) - Pay Floating (3M SEK-STIBOR)	2023年3月21日	0	(115)
SEK	11,940,000	Receive Floating (3M SEK-STIBOR) - Pay Fixed (0.50%)	2021年12月16日	0	6,414
SEK	1,590,000	Receive Floating (3M SEK-STIBOR) - Pay Fixed (0.25%)	2021年3月22日	0	(413)
CAD	3,100,000	Receive Fixed (1.25%) - Pay Floating (3M BA-CDOR CAD)	2020年3月23日	0	(42,057)
CAD	550,000	Receive Fixed (1.50%) - Pay Floating (3M BA-CDOR CAD)	2023年3月21日	0	(15,827)
CAD	1,660,000	Receive Fixed (1.75%) - Pay Floating (3M BA-CDOR CAD)	2028年3月21日	0	(76,987)
CAD	320,000	Receive Fixed (1.00%) - Pay Floating (3M BA-CDOR CAD)	2019年3月21日	0	(2,686)
AUD	1,650,000	Receive Floating (3M BBR-BBSW AUD) - Pay Fixed (2.00%)	2020年3月23日	0	6,639
AUD	670,000	Receive Floating (6M BBR-BBSW AUD) - Pay Fixed (2.75%)	2028年3月21日	0	3,922
NZD	3,640,000	Receive Floating (3M BBR-FRA NZD) - Pay Fixed (2.25%)	2020年3月23日	0	(644)
GBP	330,000	Receive Floating (6M GBP LIBOR) - Pay Fixed (1.94%)	2032年1月12日	0	(4,686)
GBP	2,200,000	Receive Floating (6M GBP LIBOR) - Pay Fixed (1.75%)	2037年3月17日	0	(20,646)
GBP	3,160,000	Receive Fixed (1.60%) - Pay Floating (6M GBP LIBOR)	2027年3月16日	0	25,891
GBP	760,000	Receive Fixed (1.20%) - Pay Floating (6M GBP LIBOR)	2023年11月21日	0	2,910
GBP	450,000	Receive Floating (6M GBP LIBOR) - Pay Fixed (1.40%)	2028年11月21日	0	(2,682)
GBP	100,000	Receive Fixed (01.00%) - Pay Floating (6M GBP LIBOR)	2023年3月21日	0	(430)
GBP	650,000	Receive Floating (6M GBP LIBOR) - Pay Fixed (1.50%)	2033年3月21日	0	(9,684)
GBP	810,000	Receive Floating (6M GBP LIBOR) - Pay Fixed (1.25%)	2028年3月21日	0	4,558
GBP	4,010,000	Receive Fixed (0.75%) - Pay Floating (6M GBP LIBOR)	2020年3月21日	0	(9,701)
GBP	370,000	Receive Floating (6M GBP LIBOR) - Pay Fixed (1.75%)	2037年12月14日	0	(3,653)
EUR	430,000	Receive Fixed (1.33%) - Pay Floating (6M EUR-EURIBOR)	2027年1月12日	0	724
EUR	340,000	Receive Floating (6M EUR-EURIBOR) - Pay Fixed (1.50%)	2027年8月31日	0	(1,568)
EUR	610,000	Receive Fixed (1.60%) - Pay Floating (6M EUR-EURIBOR)	2027年10月25日	0	5,278
EUR	1,200,000	Receive Fixed (1.00%) - Pay Floating (6M EUR-EURIBOR)	2028年3月21日	0	9,390
EUR	110,000	Receive Floating (6M EUR-EURIBOR) - Pay Fixed (0.50%)	2025年3月21日	0	1,093
EUR	2,100,000	Receive Floating (6M EUR-EURIBOR) - Pay Fixed (0.25%)	2023年3月21日	0	15,663
EUR	1,970,000	Receive Fixed (0.35%) - Pay Floating (6M EUR-EURIBOR)	2021年12月16日	0	(5,871)
EUR	720,000	Receive Fixed (1.50%) - Pay Floating (6M EUR-EURIBOR)	2027年12月20日	0	975
PLN	1,520,000	Receive Floating (6M WIBOR PLN) - Pay Fixed (2.51%)	2022年12月20日	(74)	(354)
NOK	8,050,000	Receive Floating (6M NOK NIBOR) - Pay Fixed (1.50%)	2023年3月21日	0	4,587
JPY	63,620,000	Receive Floating (6M JPY LIBOR) - Pay Fixed (0.25%)	2028年3月21日	0	1,662
				(226)	(154,166)

注記5 - クレジット・デフォルト・スワップ契約

2017年12月31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)
<i>プロテクション買いポジション</i>				
USD	165,000	CDX EM S27 100BP 1%	2022年6月20日	287
EUR	1,690,000	CDX ITRAXX EUROPE S27 5Y 1%	2022年6月20日	(56,955)
USD	1,900,000	CDX MARKIT NA IG S29 1%	2022年12月20日	(45,079)
USD	1,675,000	CDX NA HY 29 500BP 5%	2022年12月20日	(137,855)
				<u>(239,602)</u>
<i>プロテクション売りポジション</i>				
USD	3,405,000	CDX EM S28 100BP 1%	2022年12月20日	27,198
				<u>27,198</u>
				<u>(212,404)</u>

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日2017年8月21日）

作成対象期間（2016年8月20日～2017年8月21日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率	純資産額
		期騰	中率			
11期(2013年8月19日)	円 10,191		% 0.1	% 80.9	% —	百万円 5,297
12期(2014年8月19日)	10,199		0.1	59.7	—	8,648
13期(2015年8月19日)	10,206		0.1	44.7	—	22,034
14期(2016年8月19日)	10,211		0.0	68.6	—	19,722
15期(2017年8月21日)	10,208		△0.0	64.0	—	17,754

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

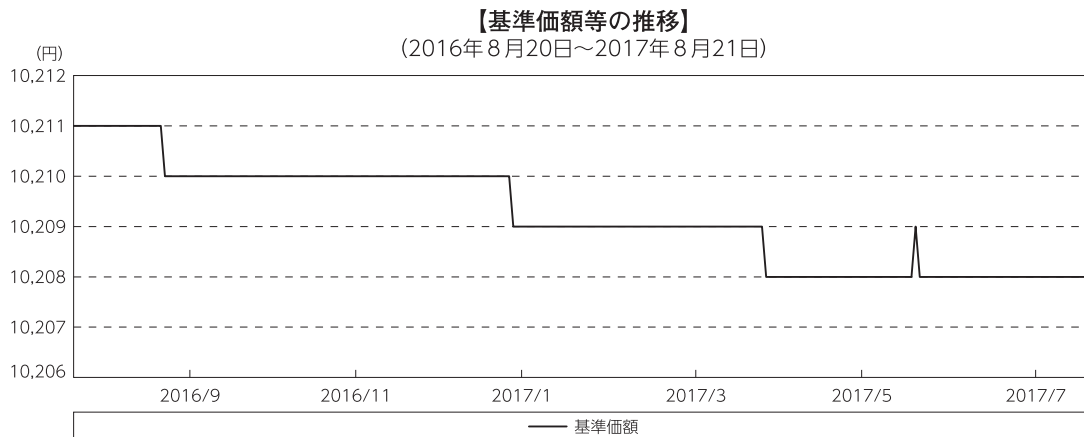
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率
		騰	落率		
(期首) 2016年8月19日	円 10,211		% —	% 68.6	% —
8月末	10,211		0.0	66.8	—
9月末	10,210		△0.0	55.4	—
10月末	10,210		△0.0	67.1	—
11月末	10,210		△0.0	81.1	—
12月末	10,210		△0.0	54.1	—
2017年1月末	10,209		△0.0	49.7	—
2月末	10,209		△0.0	48.6	—
3月末	10,209		△0.0	29.2	—
4月末	10,208		△0.0	75.0	—
5月末	10,208		△0.0	73.1	—
6月末	10,208		△0.0	65.4	—
7月末	10,208		△0.0	60.1	—
(期末) 2017年8月21日	10,208		△0.0	64.0	—

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



○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きました。

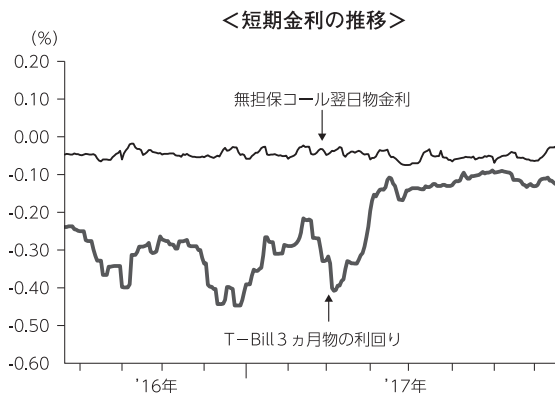
このような中、日本銀行は「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」を継続し、2016年9月には、これらの政策枠組みを強化する意味合いから「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を導入しました。

・無担保コール翌日物金利の推移

マイナス金利政策のもと、 -0.05% 程度で推移しました。

・T-Bill（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りの推移

日本銀行による買入や海外勢を中心とした投資家需要が続く中、3月下旬までの間、利回りは $-0.2\% \sim -0.4\%$ 程度で推移しました。その後は、投資家の需要減退等を背景に利回りは上昇し、期末には -0.14% となりました。



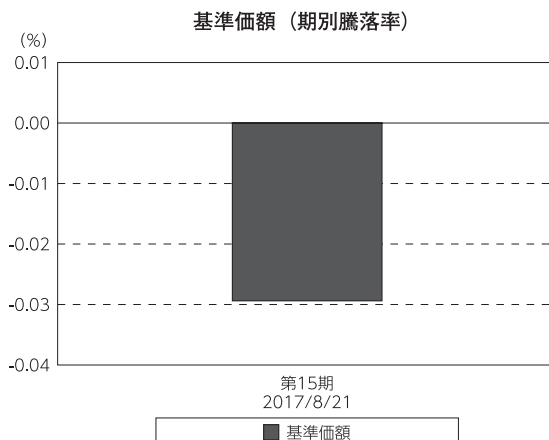
○当ファンドのポートフォリオ

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

(2016年8月20日～2017年8月21日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2016年8月20日～2017年8月21日)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	26,957,668	26,957,639
	地方債証券	7,885,120	—
内	特殊債券	18,040,131	—
	社債券（投資法人債券を含む）	16,069,442	—
			(6,738,010)
			(23,825,000)
			(13,490,000)

*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	3,599,972	—
			(3,900,000)

*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

(2016年8月20日～2017年8月21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		B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D		D C
		百万円	百万円			百万円	百万円	
公社債	百万円 41,994	百万円 4,092	% 9.7		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證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2017年8月21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	4,020,000	4,031,567	22.7	-	-	-	22.7	
	(4,020,000)	(4,031,567)	(22.7)	(-)	(-)	(-)	(22.7)	
特殊債券 (除く金融債)	1,205,000	1,207,280	6.8	-	-	-	6.8	
	(1,205,000)	(1,207,280)	(6.8)	(-)	(-)	(-)	(6.8)	
金融債券	2,090,000	2,090,748	11.8	-	-	-	11.8	
	(2,090,000)	(2,090,748)	(11.8)	(-)	(-)	(-)	(11.8)	
普通社債券 (含む投資法人債券)	4,030,000	4,034,993	22.7	-	-	-	22.7	
	(4,030,000)	(4,034,993)	(22.7)	(-)	(-)	(-)	(22.7)	
合 計	11,345,000	11,364,590	64.0	-	-	-	64.0	
	(11,345,000)	(11,364,590)	(64.0)	(-)	(-)	(-)	(64.0)	

* ()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	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
東京都 公募第651回	1.62	50,000	50,062	2017/9/20
神奈川県 公募(5年)第52回	0.26	360,000	360,089	2017/9/20
神奈川県 公募(5年)第53回	0.231	480,000	480,101	2017/9/20
大阪府 公募(5年)第86回	0.23	100,000	100,024	2017/9/27
大阪府 公募(5年)第89回	0.2	190,000	190,132	2017/12/27
京都府 公募平成24年度第9回	0.14	30,000	30,027	2018/3/22
静岡県 公募(5年)平成24年度第8回	0.236	170,000	170,059	2017/10/18
岐阜県 公募平成19年度第1回	1.87	150,000	150,496	2017/10/26
共同発行市場地方債 公募第54回	1.7	100,000	100,161	2017/9/25
共同発行市場地方債 公募第57回	1.65	900,000	905,079	2017/12/25
共同発行市場地方債 公募第58回	1.59	100,000	100,666	2018/1/25
大阪市 公募平成19年度第10回	1.74	800,000	804,416	2017/12/19
鹿児島県 公募(5年)平成24年度第1回	0.22	590,000	590,251	2017/10/31
小 計		4,020,000	4,031,567	
特殊債券(除く金融債)				
公営企業債券 政府保証第885回	1.7	33,000	33,414	2018/5/22
政保 地方公共団体金融機構債券(6年)第1回	0.4	70,000	70,033	2017/9/27
政保 地方公共団体金融機構債券(6年)第3回	0.4	20,000	20,034	2018/1/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第47回	1.5	4,000	4,020	2017/12/27
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第49回	1.5	42,000	42,274	2018/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第52回	1.6	44,000	44,360	2018/2/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第56回	1.4	25,000	25,228	2018/4/20
東日本高速道路債券 政府保証第10回	1.5	77,000	77,375	2017/12/21
新関西国際空港社債 財投機関債第10回	0.161	260,000	260,031	2017/9/20
首都高速道路 第11回	0.279	500,000	500,462	2017/12/20
東日本高速道路 第18回	0.387	130,000	130,045	2017/9/20
小 計		1,205,000	1,207,280	
金融債券				
商工債券 利付第748回い号	0.3	200,000	200,069	2017/9/27
商工債券 利付第751回い号	0.25	120,000	120,100	2017/12/27
農林債券 利付第747回い号	0.35	370,000	370,020	2017/8/25
しんきん中金債券 利付第274回	0.3	1,000,000	1,000,317	2017/9/27
商工債券 利付(3年)第179回	0.14	400,000	400,240	2017/12/27
小 計		2,090,000	2,090,748	
普通社債券(含む投資法人債券)				
関西電力 第400回	3.1	100,000	100,041	2017/8/25
関西電力 第458回	1.83	100,000	100,145	2017/9/20
北陸電力 第288回	1.89	240,000	240,754	2017/10/25
四国電力 第265回	1.79	300,000	300,065	2017/8/25
四国電力 第276回	0.592	200,000	200,111	2017/9/25
九州電力 第417回	0.641	340,000	340,036	2017/8/25
北海道電力 第293回	1.86	100,000	100,169	2017/9/25
北海道電力 第322回	0.3	350,000	350,348	2017/12/25
トヨタ自動車 第12回社債間限定同等特約付	0.317	500,000	500,142	2017/9/20
みずほコーポレート銀行 第31回特定社債間限定同順位特約付	0.33	300,000	300,177	2017/10/25
三井住友ファイナンス&リース 第7回社債間限定同順位特約付	0.442	300,000	301,250	2018/8/6

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
住友不動産 第84回社債間限定同順位特約付	0.388	100,000	100,196	2018/2/28
東日本旅客鉄道 第7回社債間限定同順位特約付	3.3	600,000	600,236	2017/8/25
東日本旅客鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	1.86	100,000	100,153	2017/9/20
東海旅客鉄道 第3回	2.825	200,000	201,066	2017/10/30
電源開発 第34回社債間限定同順位特約付	0.592	200,000	200,095	2017/9/20
小 計		4,030,000	4,034,993	
合 計		11,345,000	11,364,590	

* 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 899,993	% 5.1

* 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2017年8月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 11,364,590	% 63.6
その他有価証券	899,993	5.0
コール・ローン等、その他	5,590,335	31.4
投資信託財産総額	17,854,918	100.0

* 金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年8月21日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	17,854,918,800
コール・ローン等	5,549,998,539
公社債(評価額)	11,364,590,303
その他有価証券	899,993,268
未収利息	18,125,679
前払費用	22,211,011
(B) 負債	100,793,362
未払金	100,679,000
未払解約金	106,947
未払利息	7,415
(C) 純資産総額(A-B)	17,754,125,438
元本	17,392,173,897
次期繰越損益金	361,951,541
(D) 受益権総口数	17,392,173,897口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,208円

(注) 期首元本額は19,315,765,955円、期中追加設定元本額は2,507,553,179円、期中一部解約元本額は4,431,145,237円、1口当たり純資産額は1.0208円です。

○損益の状況 (2016年8月20日～2017年8月21日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	95,706,562
受取利息	98,717,375
支払利息	△ 3,010,813
(B) 有価証券売買損益	△100,546,660
売買損	△100,546,660
(C) 当期損益金(A+B)	△ 4,840,098
(D) 前期繰越損益金	406,859,951
(E) 追加信託差損益金	52,555,651
(F) 解約差損益金	△ 92,623,963
(G) 計(C+D+E+F)	361,951,541
次期繰越損益金(G)	361,951,541

*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)	5,423,785,404
ノムスマートプレミアムファンドハイブリッド50 (適格機関投資家監査別限付)	4,206,288,588
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Dプラス(適格機関投資家専用)	3,161,244,481
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Eプラス(適格機関投資家専用)	2,296,160,091
日本株インカムプラスα(公社債運用移行型)1305(適格機関投資家監査別限付)	969,401,962
野村日本ブランド株投資(マネーボールファンド)年2回決算型	436,168,504
野村世界高金利通貨投信	151,953,753
バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2015-06	146,986,772
ノムラ・アジア・シリーズ(マネーボール・ファンド)	98,153,976
バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2014-09	98,039,216
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134
野村米国ハイ・イールド債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型	49,417,625
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
野村新中國株投資 マネーボール・ファンド	14,424,815
野村世界業種別投資シリーズ(マネーボール・ファンド)	10,258,341
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,492,405
野村ビクテ・ジェネリック&ゲノム マネーボール・ファンド	6,983,416
野村新米国ハイ・イールド債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型	6,929,426
野村新興国消費関連株投信 マネーボール・ファンド	5,350,038
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	3,826,372
野村アフリカ株投資 マネーボール・ファンド	3,459,024
野村新エマージング債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型	3,279,122

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(マネーボールファンド)年2回決算型	3,123,334
米国変動好金利ファンド Aコース	2,952,997
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	1,937,870
野村・グリーン・テクノロジー マネーボール・ファンド	1,020,305
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

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	98,261
野村米国ブランド株投資(円コース)毎月分配型	98,261
野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース	98,261
野村ドイチュ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	98,261
第1回 野村短期公社債ファンド	98,261
第2回 野村短期公社債ファンド	98,261
第3回 野村短期公社債ファンド	98,261
第4回 野村短期公社債ファンド	98,261
第5回 野村短期公社債ファンド	98,261
第6回 野村短期公社債ファンド	98,261
第7回 野村短期公社債ファンド	98,261
第8回 野村短期公社債ファンド	98,261
第11回 野村短期公社債ファンド	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・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PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Bコース	98,260
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260
第9回 野村短期公社債ファンド	98,260
第10回 野村短期公社債ファンド	98,260
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型	98,146
ノムラ THE EUROPE Aコース	98,117
ノムラ THE EUROPE Bコース	98,117
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049
ノムラ THE ASIA Aコース	97,992
グローバル・ストック Aコース	97,953
グローバル・ストック Cコース	97,953
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	82,780
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	80,956
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型	58,906
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	52,622
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)毎月分配型	48,092
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)年2回決算型	13,741
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)年2回決算型	9,826
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	9,826
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Aコース	9,818

ファンド名	当期末
	元本額
	円
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 ブラジルリアル毎月分配型	9,803
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(円コース)	9,803
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(米ドルコース)	9,803
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(世界通貨分散コース)	9,803
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	9,801
野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)	9,801
野村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
野村高金利国際機関債投信(年2回決算型)	1,967
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)毎月分配型	1,963

〇お知らせ

スワップ取引に係る評価の方法につき、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価する汎用的な記載に変更する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2017年3月31日＞

< 「野村グローバルボンド投信（通貨選択型）」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よろしくお願いいたします。

(2018年8月6日現在)

年 月	日
2018年8月	15、27
9月	3
10月	—
11月	1、12、22
12月	25、26

※2018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。