

野村グローバルボンド投信 Cコース

運用報告書(全体版)

第30期(決算日2017年3月6日) 第31期(決算日2017年4月6日) 第32期(決算日2017年5月8日)
第33期(決算日2017年6月6日) 第34期(決算日2017年7月6日) 第35期(決算日2017年8月7日)

作成対象期間(2017年2月7日~2017年8月7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、通常の状態においては、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 C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 C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、原則として利子・配当等収益等を中心に分配を行うことを基本とします。ただし、基準価額水準等によっては、売買益等が中心となる場合があります。なお、市況動向や基準価額水準等によっては、分配金額が大きく変動する場合があります。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30期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額			債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	投 証 組 入	信 託 組 入	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 金							
	円	円	円	%	%	%	%	%	%	百万円	
6期(2015年3月6日)	9,934		10	0.9	0.0	—	—	99.0		1,025	
7期(2015年4月6日)	9,898		10	△0.3	0.0	—	—	98.8		1,010	
8期(2015年5月7日)	9,914		10	0.3	0.0	—	—	98.8		1,064	
9期(2015年6月8日)	9,876		10	△0.3	0.0	—	—	99.1		1,059	
10期(2015年7月6日)	9,835		10	△0.3	0.0	—	—	99.1		1,127	
11期(2015年8月6日)	9,795		10	△0.3	0.0	—	—	99.0		925	
12期(2015年9月7日)	9,684		10	△1.0	0.0	—	—	99.0		926	
13期(2015年10月6日)	9,482		10	△2.0	0.0	—	—	99.0		834	
14期(2015年11月6日)	9,631		10	1.7	0.0	—	—	98.9		782	
15期(2015年12月7日)	9,466		10	△1.6	0.0	—	—	99.0		705	
16期(2016年1月6日)	9,323		10	△1.4	0.0	—	—	98.8		664	
17期(2016年2月8日)	9,151		10	△1.7	0.0	—	—	98.9		629	
18期(2016年3月7日)	9,282		10	1.5	0.0	—	—	99.0		610	
19期(2016年4月6日)	9,397		10	1.3	0.0	—	—	99.0		600	
20期(2016年5月6日)	9,534		10	1.6	0.0	—	—	98.7		608	
21期(2016年6月6日)	9,577		10	0.6	0.0	—	—	99.0		579	
22期(2016年7月6日)	9,579		10	0.1	0.0	—	—	98.2		588	
23期(2016年8月8日)	9,715		10	1.5	0.0	—	—	98.9		616	
24期(2016年9月6日)	9,796		10	0.9	0.0	—	—	99.0		609	
25期(2016年10月6日)	9,806		10	0.2	0.0	—	—	99.0		614	
26期(2016年11月7日)	9,758		10	△0.4	0.0	—	—	99.0		567	
27期(2016年12月6日)	9,807		10	0.6	0.0	—	—	98.9		755	
28期(2017年1月6日)	9,922		10	1.3	0.0	—	—	98.8		735	
29期(2017年2月6日)	9,906		10	△0.1	0.0	—	—	98.4		803	
30期(2017年3月6日)	10,001		10	1.1	0.0	—	—	99.0		807	
31期(2017年4月6日)	9,926		10	△0.6	0.0	—	—	99.0		772	
32期(2017年5月8日)	9,953		10	0.4	0.0	—	—	99.0		706	
33期(2017年6月6日)	9,954		10	0.1	0.0	—	—	98.8		726	
34期(2017年7月6日)	9,942		10	△0.0	0.0	—	—	99.0		706	
35期(2017年8月7日)	9,951		10	0.2	0.0	—	—	97.5		716	

*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。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 券 率
			騰 落 率	率			
第30期	(期 首)	円	%	%	%	%	%
	2017年2月6日	9,906	—	0.0	—	—	98.4
	2月末	9,967	0.6	0.0	—	—	98.6
第31期	(期 末)						
	2017年3月6日	10,011	1.1	0.0	—	—	99.0
	(期 首)						
第31期	2017年3月6日	10,001	—	0.0	—	—	99.0
	3月末	9,930	△0.7	0.0	—	—	98.9
	(期 末)						
第32期	2017年4月6日	9,936	△0.6	0.0	—	—	99.0
	(期 首)						
	2017年4月6日	9,926	—	0.0	—	—	99.0
第32期	4月末	9,947	0.2	0.0	—	—	98.9
	(期 末)						
	2017年5月8日	9,963	0.4	0.0	—	—	99.0
第33期	(期 首)						
	2017年5月8日	9,953	—	0.0	—	—	99.0
	5月末	9,959	0.1	0.0	—	—	98.2
第33期	(期 末)						
	2017年6月6日	9,964	0.1	0.0	—	—	98.8
	(期 首)						
第34期	2017年6月6日	9,954	—	0.0	—	—	98.8
	6月末	9,941	△0.1	0.0	—	—	98.8
	(期 末)						
第35期	2017年7月6日	9,952	△0.0	0.0	—	—	99.0
	(期 首)						
	2017年7月6日	9,942	—	0.0	—	—	99.0
第35期	7月末	9,968	0.3	0.0	—	—	98.7
	(期 末)						
	2017年8月7日	9,961	0.2	0.0	—	—	97.5

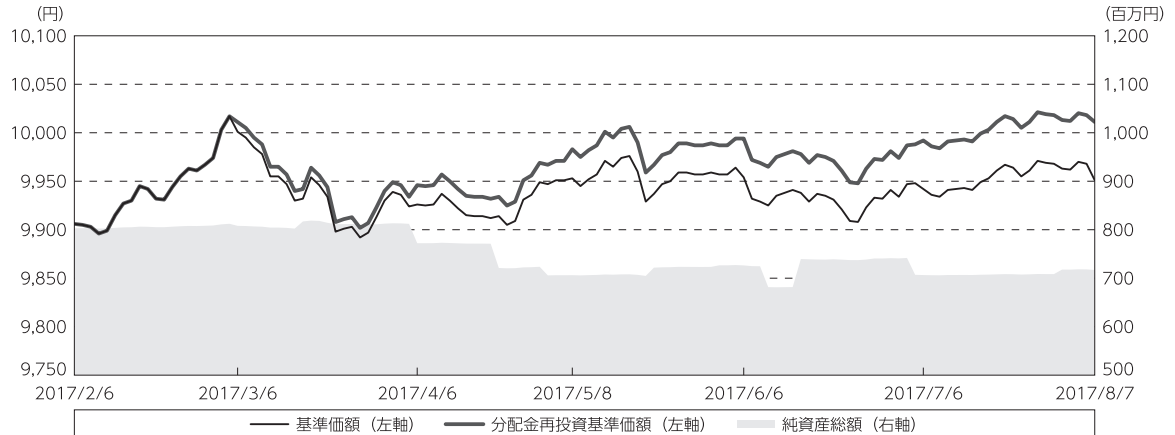
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



第30期首：9,906円

第35期末：9,951円 (既払分配金(税込み)：60円)

騰落率：1.1% (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(2017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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、当作成期首9,906円から当作成期末には9,951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＞

米トランプ政権の税制改革案に対する期待が高まったことや、フランス大統領選挙の結果を受けて投資家のリスク回避姿勢が和らいだこと、FRB（米連邦準備制度理事会）による金融引き締めペースが緩やかになるとの見方が強まったことなどを背景に、当作成期間で値上がりとなりました。

＜バンクローン市場＞

米トランプ大統領の政策に対する期待が高まったことや、概ね堅調な米国経済指標が発表されたこと、FRBによる追加利上げ観測が後退したことなどから、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 Cコース（米ドル売り円買い 毎月分配型）]

[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5.7%、AA格6.1%、A格7.7%、BBB格6.5%、BB格15.8%、B格39.3%、CCC格以下および無格付12.8%となりました。

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

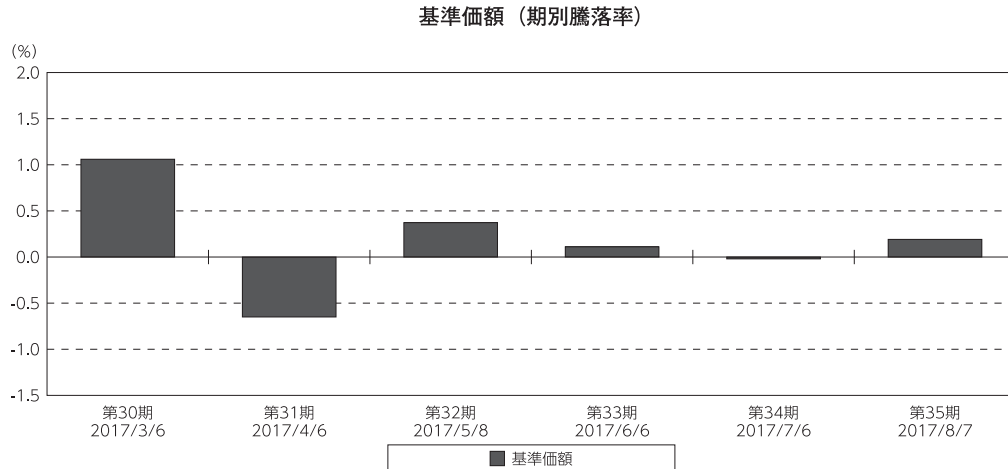
[野村マネー マザーファンド]

残存期間の短い高格付けの公社債によってポートフォリオを構築し、流動性に関しては、コール・ローン等により運用いたしました。

○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、作成期間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、期毎の分配原資の範囲内で、原則として、利子・配当等収益等を中心に分配を行いました。

留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第30期	第31期	第32期	第33期	第34期	第35期
	2017年2月7日～ 2017年3月6日	2017年3月7日～ 2017年4月6日	2017年4月7日～ 2017年5月8日	2017年5月9日～ 2017年6月6日	2017年6月7日～ 2017年7月6日	2017年7月7日～ 2017年8月7日
当期分配金 (対基準価額比率)	10 0.100%	10 0.101%	10 0.100%	10 0.100%	10 0.100%	10 0.100%
当期の収益	10	10	10	10	10	10
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	1,166	1,182	1,200	1,215	1,233	1,247

(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 Cコース (米ドル売り円買い 毎月決算型)]

[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。通常の状態においては、「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]

今後も、残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行い、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

(2017年2月7日～2017年8月7日)

項 目	第30期～第35期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 54	% 0.539	(a)信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(9)	(0.092)	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)	(0.431)	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＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
(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	0.540	
作成期間の平均基準価額は、9,952円です。			

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

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

*各項目の費用は、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）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2017年2月7日～2017年8月7日)

投資信託証券

銘 柄	第30期～第35期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内	口	千円	口	千円
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-IVクラス	10,437	92,154	20,418	179,633

*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

(2017年2月7日～2017年8月7日)

利害関係人との取引状況

<野村グローバルボンド投信 C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	第30期～第35期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 25,247	百万円 2,967	% 11.8	百万円 -	百万円 -	% -

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2017年8月7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	第29期末	第35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 89,326	口 79,345	千円 698,870	% 97.5
合 計	89,326	79,345	698,870	97.5

*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託残高

銘 柄	第29期末	第35期末	
	口 数	口 数	評 価 額
野村マネー マザーファンド	千口 98	千口 98	千円 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

(2017年8月7日現在)

項 目	第35期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	698,870	97.3
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	19,362	2.7
投資信託財産総額	718,332	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

項 目	第30期末	第31期末	第32期末	第33期末	第34期末	第35期末
	2017年3月6日現在	2017年4月6日現在	2017年5月8日現在	2017年6月6日現在	2017年7月6日現在	2017年8月7日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	812,322,336	813,659,620	725,185,719	733,999,359	742,651,291	718,332,771
コール・ローン等	11,956,590	9,607,918	25,828,802	16,493,937	9,557,296	19,361,923
投資信託受益証券(評価額)	800,265,648	764,531,190	699,256,829	717,405,334	699,188,140	698,870,760
野村マネー マザーファンド(評価額)	100,098	100,098	100,088	100,088	100,088	100,088
未収入金	—	39,420,414	—	—	33,805,767	—
(B) 負債	4,378,112	41,523,307	18,998,729	7,667,321	36,217,226	1,393,406
未払金	—	—	—	6,322,280	—	—
未払収益分配金	807,886	777,857	709,539	729,707	710,589	720,457
未払解約金	2,900,912	40,000,000	17,588,376	—	34,861,593	—
未払信託報酬	667,976	743,958	699,384	614,096	643,759	671,594
未払利息	14	13	44	25	13	27
その他未払費用	1,324	1,479	1,386	1,213	1,272	1,328
(C) 純資産総額(A-B)	807,944,224	772,136,313	706,186,990	726,332,038	706,434,065	716,939,365
元本	807,886,002	777,857,741	709,539,248	729,707,572	710,589,563	720,457,611
次期繰越損益金	58,222	△ 5,271,428	△ 3,352,258	△ 3,375,534	△ 4,155,498	△ 3,518,246
(D) 受益権総口数	807,886,002口	777,857,741口	709,539,248口	729,707,572口	710,589,563口	720,457,611口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,001円	9,926円	9,953円	9,954円	9,942円	9,951円

(注) 第30期首元本額は810,628,322円、第30～35期中追加設定元本額は106,252,245円、第30～35期中一部解約元本額は196,422,956円、1口当たり純資産額は、第30期1.0001円、第31期0.9926円、第32期0.9953円、第33期0.9954円、第34期0.9942円、第35期0.9951円です。

○損益の状況

項 目	第30期	第31期	第32期	第33期	第34期	第35期
	2017年2月7日～ 2017年3月6日	2017年3月7日～ 2017年4月6日	2017年4月7日～ 2017年5月8日	2017年5月9日～ 2017年6月6日	2017年6月7日～ 2017年7月6日	2017年7月7日～ 2017年8月7日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	2,684,515	2,630,505	2,379,468	2,413,428	2,384,540	2,379,839
受取配当金	2,684,882	2,630,958	2,380,022	2,413,980	2,385,522	2,380,350
支払利息	△ 367	△ 453	△ 554	△ 552	△ 982	△ 511
(B) 有価証券売買損益	6,422,973	△ 6,911,162	704,801	△ 959,135	△ 2,042,105	△ 317,391
売買益	6,446,642	438,231	931,977	—	202,768	—
売買損	△ 23,669	△ 7,349,393	△ 227,176	△ 959,135	△ 2,244,873	△ 317,391
(C) 信託報酬等	△ 669,300	△ 745,437	△ 700,770	△ 615,309	△ 645,031	△ 672,922
(D) 当期損益金(A+B+C)	8,438,188	△ 5,026,094	2,383,499	838,984	△ 302,596	1,389,526
(E) 前期繰越損益金	4,231,530	11,340,318	5,242,205	6,916,165	6,503,076	5,489,842
(F) 追加信託差損益金	△11,803,610	△11,257,795	△10,268,423	△10,400,976	△ 9,645,389	△ 9,677,157
(配当等相当額)	(42,452,817)	(41,771,427)	(38,108,261)	(40,539,520)	(43,334,658)	(44,578,109)
(売買損益相当額)	(△54,256,427)	(△53,029,222)	(△48,376,684)	(△50,940,496)	(△52,980,047)	(△54,255,266)
(G) 計(D+E+F)	866,108	△ 4,943,571	△ 2,642,719	△ 2,645,827	△ 3,444,909	△ 2,797,789
(H) 収益分配金	△ 807,886	△ 777,857	△ 709,539	△ 729,707	△ 710,589	△ 720,457
次期繰越損益金(G+H)	58,222	△ 5,721,428	△ 3,352,258	△ 3,375,534	△ 4,155,498	△ 3,518,246
追加信託差損益金	△11,803,610	△11,257,795	△10,268,423	△10,400,976	△ 9,645,389	△ 9,677,157
(配当等相当額)	(42,452,817)	(41,771,427)	(38,108,261)	(40,539,521)	(43,334,663)	(44,578,109)
(売買損益相当額)	(△54,256,427)	(△53,029,222)	(△48,376,684)	(△50,940,497)	(△52,980,052)	(△54,255,266)
分配準備積立金	51,787,597	50,198,253	47,105,830	48,174,304	44,320,928	45,306,844
繰越損益金	△39,925,765	△44,661,886	△40,189,665	△41,148,862	△38,831,037	△39,147,933

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

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

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

(注) 分配金の計算過程(2017年2月7日～2017年8月7日)は以下の通りです。

項 目	第30期	第31期	第32期	第33期	第34期	第35期
	2017年2月7日～ 2017年3月6日	2017年3月7日～ 2017年4月6日	2017年4月7日～ 2017年5月8日	2017年5月9日～ 2017年6月6日	2017年6月7日～ 2017年7月6日	2017年7月7日～ 2017年8月7日
a. 配当等収益(経費控除後)	2,487,238円	1,885,096円	1,838,850円	1,798,181円	1,739,565円	1,706,968円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越大損金補填後)	0円	0円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	42,452,817円	41,771,427円	38,108,261円	40,539,521円	43,334,663円	44,578,109円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	50,108,245円	49,091,014円	45,976,519円	47,105,830円	43,291,952円	44,320,333円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	95,048,300円	92,747,537円	85,923,630円	89,443,532円	88,366,180円	90,605,410円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,176円	1,192円	1,210円	1,225円	1,243円	1,257円
g. 分配金	807,886円	777,857円	709,539円	729,707円	710,589円	720,457円
h. 分配金(1万口当たり)	10円	10円	10円	10円	10円	10円

○分配金のお知らせ

	第30期	第31期	第32期	第33期	第34期	第35期
1万口当たり分配金(税込み)	10円	10円	10円	10円	10円	10円

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金(特別分配金)となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金(特別分配金)となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○(参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

(2017年8月7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(17,390,952千口)の内容です。

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	第35期末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	3,730,000	3,742,162	21.1	—	—	—	21.1
	(3,730,000)	(3,742,162)	(21.1)	(—)	(—)	(—)	(21.1)
特殊債券 (除く金融債)	1,805,000	1,807,968	10.2	—	—	—	10.2
	(1,805,000)	(1,807,968)	(10.2)	(—)	(—)	(—)	(10.2)
金融債券	2,090,000	2,090,965	11.8	—	—	—	11.8
	(2,090,000)	(2,090,965)	(11.8)	(—)	(—)	(—)	(11.8)
普通社債券 (含む投資法人債券)	3,730,000	3,735,679	21.0	—	—	—	21.0
	(3,730,000)	(3,735,679)	(21.0)	(—)	(—)	(—)	(21.0)
合 計	11,355,000	11,376,776	64.1	—	—	—	64.1
	(11,355,000)	(11,376,776)	(64.1)	(—)	(—)	(—)	(64.1)

* () 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	第35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	50,089	2017/9/20
神奈川県 公募(5年)第52回	0.26	360,000	360,118	2017/9/20
神奈川県 公募(5年)第53回	0.231	480,000	480,130	2017/9/20
大阪府 公募(5年)第86回	0.23	100,000	100,032	2017/9/27
京都府 公募平成24年度第9回	0.14	30,000	30,028	2018/3/22
静岡県 公募(5年)平成24年度第8回	0.236	170,000	170,072	2017/10/18
岐阜県 公募平成19年度第1回	1.87	150,000	150,601	2017/10/26
共同発行市場地方債 公募第54回	1.7	100,000	100,226	2017/9/25
共同発行市場地方債 公募第57回	1.65	900,000	905,635	2017/12/25
大阪市 公募平成19年度第10回	1.74	800,000	804,929	2017/12/19
鹿児島県 公募(5年)平成24年度第1回	0.22	590,000	590,298	2017/10/31
小 計		3,730,000	3,742,162	
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	33,435	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	70,044	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	20,037	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	4,022	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	42,298	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	44,387	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	25,241	2018/4/20
東日本高速道路債券 政府保証第10回	1.5	77,000	77,418	2017/12/21
新関西国際空港社債 財投機関債第10回	0.161	260,000	260,045	2017/9/20
首都高速道路 第11回	0.279	500,000	500,510	2017/12/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第5回	2.01	600,000	600,461	2017/8/21
東日本高速道路 第18回	0.387	130,000	130,066	2017/9/20
小 計		1,805,000	1,807,968	
金融債券				
商工債券 利付第748回い号	0.3	200,000	200,089	2017/9/27
商工債券 利付第751回い号	0.25	120,000	120,110	2017/12/27
農林債券 利付第747回い号	0.35	370,000	370,065	2017/8/25
しんきん中金債券 利付第274回	0.3	1,000,000	1,000,437	2017/9/27
商工債券 利付(3年)第179回	0.14	400,000	400,263	2017/12/27
小 計		2,090,000	2,090,965	
普通社債券(含む投資法人債券)				
関西電力 第400回	3.1	100,000	100,156	2017/8/25
関西電力 第458回	1.83	100,000	100,210	2017/9/20
北陸電力 第288回	1.89	240,000	240,916	2017/10/25
四国電力 第265回	1.79	300,000	300,264	2017/8/25
四国電力 第276回	0.592	200,000	200,154	2017/9/25
九州電力 第417回	0.641	340,000	340,112	2017/8/25
北海道電力 第293回	1.86	100,000	100,234	2017/9/25
北海道電力 第322回	0.3	350,000	350,386	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	500,201	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	300,213	2017/10/25
住友不動産 第84回社債間限定同順位特約付	0.388	100,000	100,211	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	600,981	2017/8/25

銘	柄	第35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	
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	100,225	2017/9/20
東海旅客鉄道 第3回		2.825	200,000	201,277	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	200,135	2017/9/20
小 計			3,730,000	3,735,679	
合 計			11,355,000	11,376,776	

*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	第35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、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

2016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	<p>●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。</p> <p>※1 ハイ・イールド債とは、スタンダード・アンド・プアーズ社による格付が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。</p> <p>※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するローンをいいます。</p> <p>●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。</p>								
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>投資戦略</th> <th>主な投資方針</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>ハイ・イールド債戦略</td> <td>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。</td> </tr> <tr> <td>バンクローン戦略</td> <td>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。</td> </tr> <tr> <td>ストラテジック・インカム/トータル・リターン戦略</td> <td>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。</td> </tr> </tbody> </table>	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。								
<p>●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、債券等と比べ弁済順位が高く、取得時においてスタンダード・アンド・プアーズ社による格付が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。</p> <p>●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。</p> <p>●USDクラスについては、対円の為替ヘッジを行いません。</p> <p>●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。</p> <p>●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。</p> <p>●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。</p> <p>●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。</p>									
<p><CRSクラスにおける通貨運用方針></p> <p>●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(原則、毎月)見直すこととします。</p> <p>●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。</p> <p>●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。</p>									
受託会社	グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー								
投資顧問会社	野村アセットマネジメント株式会社								
管理事務代行会社 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。

「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(「カストディール」)に基づき、保管銀行から受益者または受益者のために投資顧問会社が任命した「独立した代理人」に対し、米国法で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。投資顧問会社はArthur F. Bell, Jr. & Associates, L.L.C.(「アーサー・ベル社」)を、「独立した代理人」に任命しました。

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

純資産計算書
2016年12月31日現在
(金額は米ドル表示)

資産		
投資有価証券時価		255,489,562
<i>(取得原価: 262,345,263 米ドル)</i>		
現金預金等		9,198,178
外国為替先渡し契約に係る評価差益		4,041,199
デリバティブ取引に係る委託証拠金		1,650,246
金利スワップ契約に係る未収利息		705
ブローカーからの受取金		5,212,123
受益証券発行未収金		721,240
未収収益		2,692,973
現金および現金等価物に係る利息		644
設立費用		7,100
資産合計		279,013,970
負債		
銀行借越金		455,281
金利スワップ契約に係る評価差損		206,652
先物契約に係る評価差損		97,632
クレジット・デフォルト・スワップ契約に係る評価差損		111,399
受益証券買戻支払金		323,374
ブローカーへの未払金		8,328,058
未払費用		707,367
負債合計		10,229,763
純資産総額		268,784,207

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)	8,852	172,422	1,526,279,706
通貨セレクトクラス(円)	5,453	2,435,905	13,284,086,794
米ドルクラス(円)	10,455	1,593,702	16,661,593,227

運用計算書

2016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	47,385
債券利息	14,793,781
金利スワップ契約に係る受取利息	11,919
受取配当金等	460,906
雑収益	334
収益合計	15,314,325
費用	
投資顧問および共同投資顧問報酬	2,464,184
事務管理代行報酬	312,402
保管費用	94,087
源泉徴収税	4,168
金利スワップ契約に係る支払利息	7,746
当座借越利息	2,056
取引銀行報酬	154,059
銀行手数料	413,945
受託報酬	62,532
法務報酬	2,003
立替費用	31,172
専門家報酬	62,192
設立費用償却	14,200
雑費用	724
費用合計	3,625,470
純投資損益	11,688,855
投資有価証券売買に係る損益	(4,953,034)
先物契約に係る損益	(1,138,227)
外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益	973,851
金利スワップ契約に係る損益	219,260
クレジット・デフォルト・スワップ契約に係る損益	(269,920)
当期実現純損益	(5,168,070)
投資有価証券評価損益の増減	20,012,006
先物契約に係る評価損益の増減	(562,843)
金利スワップ契約に係る評価損益の増減	(243,819)
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	1,091
外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減	7,202,144
当期評価差損益	26,408,579
運用の結果による純資産の増減額	32,929,364

純資産変動計算書
2016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	340,279,090
純投資損益	11,688,855
当期実現純損益	(5,168,070)
当期評価差損益	26,408,579
運用の結果による純資産の増減額	32,929,364
受益証券の発行手取金	43,375,783
受益証券の買戻支払金	(97,562,519)
	(54,186,736)
受益者への支払分配金	(50,237,511)
期末純資産総額	268,784,207

発行済受益証券数の変動表
2016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	148,525
発行受益証券数	96,877
買戻受益証券数	(72,980)
期末現在発行済受益証券数	172,422
通貨セレクトクラス	
期首受益証券数	2,388,696
発行受益証券数	543,556
買戻受益証券数	(496,347)
期末現在発行済受益証券数	2,435,905
米ドルクラス	
期首受益証券数	2,261,640
発行受益証券数	93,403
買戻受益証券数	(761,341)
期末現在発行済受益証券数	1,593,702

統計情報
2016年12月31日現在
(未監査)

	2016	2015	2014
期末純資産総額(米ドル)	268,784,207	340,279,090	423,023,063
日本円クラス(円)			
期末純資産総額	1,526,279,706	1,294,344,326	1,408,343,284
期末1口当たり純資産価格	8,852	8,715	9,694
通貨セレクトクラス(円)			
期末純資産総額	13,284,086,794	15,977,090,312	21,608,194,312
期末1口当たり純資産価格	5,453	6,689	10,002
米ドルクラス(円)			
期末純資産総額	16,661,593,227	23,711,779,645	27,530,491,534
期末1口当たり純資産価格	10,455	10,484	11,375

組入資産明細
2016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(%)
オーストラリア					
変動金利債					
USD	700,000	WESTPAC BKG CORP FRN 28/02/23 EMTN	722,017	709,854	0.27
			722,017	709,854	0.27
普通社債(固定金利債)					
USD	72,000	FMG RES AUG 06 9.75% 01/03/22 144A	68,133	83,525	0.03
			68,133	83,525	0.03
		合計: オーストラリア	790,150	793,379	0.30
ベルギー					
国債					
EUR	1,305,000	BELGIUM KINGDOM 2.6% 22/06/24 72	1,862,486	1,621,956	0.60
			1,862,486	1,621,956	0.60
		合計: ベルギー	1,862,486	1,621,956	0.60
バミューダ諸島					
普通社債(固定金利債)					
USD	300,000	AIRCATTLE LTD 5.125% 15/03/21	306,375	319,499	0.11
USD	200,000	DIGICEL LTD 6.75% 01/03/23 144A	200,000	180,326	0.07
USD	153,000	NCL CORP 4.625% 15/11/20 144A	153,044	155,678	0.06
USD	112,000	VIKING CRUISES LTD 6.25% 15/5/25 14	112,000	104,160	0.04
USD	89,000	NCL CORP 4.75% 15/12/21 144A	89,000	88,945	0.03
USD	89,000	WEATHERFORD BERMUDA 6.75% 15/09/40	67,552	71,200	0.03
USD	25,000	WEATHERFORD BERMUDA 6.5% 01/08/36	20,375	20,063	0.01
			948,346	939,871	0.35
		合計: バミューダ諸島	948,346	939,871	0.35
英領ヴァージン諸島					
普通社債(固定金利債)					
USD	650,000	SINOPEC GRP OVERS 3.90% 17/5/22 REG	662,600	668,469	0.25
			662,600	668,469	0.25
		合計: 英領ヴァージン諸島	662,600	668,469	0.25
カナダ					
普通社債(固定金利債)					
USD	440,000	VPII ESCROW CORP 7.5% 15/07/21 144A	465,117	371,799	0.13
USD	358,000	BOMBARDIER INC 6% 15/10/22 144A	359,402	336,519	0.12
USD	310,000	BROOKFIELD RESID 6.375% 15/5/25 144	310,035	309,225	0.11
USD	200,000	BKW 6% 01/04/22 144A	200,115	209,000	0.07
USD	172,000	BOMBARDIER INC 7.5% 15/03/25 144A	169,805	169,939	0.06
USD	149,000	NORBORD INC 6.25% 15/04/23 144A	150,025	154,215	0.06
USD	200,000	VRX ESCROW 6.125% 15/4/25 144A	171,253	150,250	0.06
USD	150,000	TECK RESOURCES LTD 6.125% 01/10/35	146,813	145,500	0.05
USD	128,000	TECK RESOURCES LTD 6% 15/08/40	106,011	121,600	0.05
USD	125,000	TECH RESOURCES LTD 6.25% 15/07/41	99,750	120,460	0.04
USD	146,000	VRX ESCROW 5.875% 15/05/23 144A	146,000	110,230	0.04
USD	100,000	TECK RESOURCES LTD 4.75% 15/01/22	88,135	100,250	0.04
USD	75,000	OPEN TEXT CORP 5.875% 01/06/26 144A	75,156	79,313	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	75,000	CASCADES INC 5.75% 15/07/23 144A	75,000	76,125	0.03
USD	75,000	FIRST QUANTUM MIN 6.75% 15/02/20 14	71,250	74,813	0.03
USD	75,000	IAMGOLD CORP 6.75% 01/10/20 144A	70,500	73,125	0.03
USD	58,000	TECK RESOURCES LTD 3.75% 01/02/23	46,183	54,810	0.02
USD	50,000	PARAMOUNT RES 6.875% 30/06/23 144A	50,563	53,000	0.02
USD	50,000	BOMBARDIER INC 6.125% 15/01/23 144A	44,031	47,670	0.02
USD	50,000	MEG ENERGY CORP 7% 31/03/24 144A	42,875	45,250	0.02
USD	41,000	LG FINANCECO 5.875% 01/11/24 144A	41,000	41,615	0.02
USD	92,000	CONCORDIA HEALTH 9.5% 21/10/22 144A	65,310	32,660	0.01
USD	34,000	CONCORDIA INTL 9% 01/04/22 144A	34,105	28,645	0.01
USD	25,000	KINROSS GOLD CORP 5.125% 01/09/21	25,875	25,391	0.01
USD	25,000	PRECISION DRILL 6.5% 15/12/21	20,813	25,313	0.01
USD	25,000	KISSNER GR HDG 8.375% 01/12/22 144A	25,000	25,250	0.01
USD	76,000	CONCORDIA HLTH COR 7% 15/04/23 144A	64,719	23,940	0.01
USD	25,000	PRECISION DRILLING 5.25% 15/11/24	20,000	23,375	0.01
USD	25,000	GARDA WORLD SEC 7.25% 15/11/21 144A	22,188	23,250	0.01
USD	25,000	MEG ENERGY CORP 6.375% 30/1/23 144A	21,688	22,250	0.01
USD	27,000	VALEANT PHARMA 5.625% 01/12/21 144A	21,229	20,925	0.01
USD	200,000	SANJEL CORP 7.5% 19/06/19	153,000	200	0.00
			3,402,946	3,095,907	1.15
		合計: カナダ	3,402,946	3,095,907	1.15
		ケイマン諸島			
資産担保証券					
USD	500,000	STNY 07-1A A1 CLO FRN 18/04/22	147,899	149,473	0.05
USD	750,000	WESTW 07-2A A1 CLO FRN 25/4/22	74,312	75,954	0.03
			222,211	225,427	0.08
ステップアップ/ダウン債					
USD	50,000	TRANSOCEAN INC STUP 3.8% 15/10/22	39,833	43,875	0.02
			39,833	43,875	0.02
普通社債(固定金利債)					
USD	650,000	MIZUHO FIN GP CAY 4.2% 18/7/22 REGS	680,982	678,595	0.24
USD	400,000	UPCB FINANCE IV 5.375% 15/1/25 144A	390,500	403,000	0.15
USD	214,000	SEAGATE HDD CAY 4.75% 01/06/23	196,078	212,128	0.08
USD	200,000	NEXTEER AUTO 5.875% 15/11/21 144A	200,000	207,500	0.08
USD	200,000	WYNN MACAU 5.25% 15/10/21 144A	193,500	201,500	0.07
USD	200,000	ALIBABA GP HDGS 2.5% 28/11/19	199,236	200,899	0.07
USD	84,000	NOBLE HDGS INTL 6.95% 01/04/45	57,818	69,930	0.03
USD	101,000	NOBLE HDGS INTL 6.05% 01/03/41	59,228	69,690	0.03
USD	72,000	SEAGATE HDD CAY 4.75% 01/01/25	55,260	68,594	0.03
USD	50,000	NOBLE HDGS INTL 7.75% 15/01/24	49,005	47,030	0.02
USD	3,000	NOBLE HDGS INTL 4.9% 01/08/20	2,483	3,045	0.00
			2,084,090	2,161,911	0.80
		合計: ケイマン諸島	2,346,134	2,431,213	0.90
		ドミニカ共和国			
国債					
USD	100,000	DOMINICAN REP 7.45% 30/04/44 144A	111,440	101,000	0.03
			111,440	101,000	0.03
その他債券					
USD	100,000	DOMINICAN REP 5.875% 18/04/24 REGS	103,100	100,254	0.04
			103,100	100,254	0.04
		合計: ドミニカ共和国	214,540	201,254	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(%)
フランス					
変動金利債					
EUR	200,000	SCOR SE FRN 27/05/48	223,520	215,225	0.09
EUR	200,000	TOTAL SA 2.625% 29/12/49	231,595	197,814	0.07
USD	200,000	BNP PARIBAS FRN 29/12/49 144A	200,000	197,250	0.07
USD	200,000	EDF FRN 29/12/49 144A	210,000	189,500	0.07
			865,115	799,789	0.30
国債					
EUR	450,000	FRANCE OAT 3.25% 25/05/45	697,408	651,584	0.24
			697,408	651,584	0.24
普通社債(固定金利債)					
USD	500,000	EDF 6.95% 26/01/39	671,500	619,176	0.24
USD	600,000	BNP PARIBAS 4.25% 15/10/24	601,250	600,469	0.22
EUR	400,000	BANQUE FED CRED 2.625% 18/03/24 EMT	553,530	475,335	0.18
USD	407,000	NUMERICABLE SFR 7.375% 01/05/26 144	409,250	416,158	0.15
USD	400,000	NUMERICABLE GRP 6% 15/05/22 144A	405,750	409,876	0.15
EUR	300,000	BNP PARIBAS 2.375% 20/05/24 EMTN	406,397	350,138	0.13
			3,047,677	2,871,152	1.07
		合計: フランス	4,610,200	4,322,525	1.61
ドイツ					
変動金利債					
EUR	700,000	ALLIANZ SE FRN 29/09/49	879,224	754,954	0.29
USD	200,000	DEUTSCHE BANK FRN 29/12/49	200,130	182,044	0.07
			1,079,354	936,998	0.36
国債					
EUR	35,000	BUNDESREP DEUTSCHLAND 2.5% 15/8/46	51,321	51,791	0.02
EUR	25,000	BUNDES DEUTSCH 3.25% 04/07/42	38,716	40,689	0.01
			90,037	92,480	0.03
普通社債(固定金利債)					
USD	400,000	UNITYMEDIA KABEL 6.125% 15/01/25 14	401,250	411,000	0.15
			401,250	411,000	0.15
		合計: ドイツ	1,570,641	1,440,478	0.54
ガーンジー島					
変動金利債					
USD	200,000	CREDIT SUISSE GUERNSEY FRN 11/12/49	213,167	209,644	0.08
			213,167	209,644	0.08
		合計: ガーンジー島	213,167	209,644	0.08
インドネシア					
国債					
EUR	150,000	REP OF INDONESIA 2.625% 14/6/23 REG	168,781	158,563	0.06
			168,781	158,563	0.06
		合計: インドネシア	168,781	158,563	0.06
アイルランド					
変動金利債					
USD	200,000	ARDAGH PKG FIN FRN 15/12/19 144A	197,875	204,000	0.08
			197,875	204,000	0.08

通貨	数量/ 額面価格 ⁽¹⁾	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
国債					
EUR	1,250,000	IRISH GVT 2.4% 15/05/30	1,524,401	1,514,042	0.56
			1,524,401	1,514,042	0.56
普通社債(固定金利債)					
USD	200,000	GRIFOLS WORLDWIDE 5.25% 01/04/22	209,000	207,000	0.08
USD	50,000	ALLEGION PLC 5.875% 15/09/23	50,000	53,000	0.02
			259,000	260,000	0.10
		合計: アイルランド	1,981,276	1,978,042	0.74
日本					
国債					
JPY	99,700,000	JAPAN GVT 10YR 0.1% 10/03/25 CPI 20	1,021,043	903,259	0.34
JPY	27,750,000	JAPAN GVT 10YR 1.7% 20/03/17 285	245,335	238,040	0.09
JPY	20,400,000	JAPAN GVT 2YR 0.1% 15/03/17 350	179,546	174,364	0.06
JPY	11,600,000	JAPAN GVT 20YR 3.5% 20/03/17 34	103,056	99,891	0.04
			1,548,980	1,415,554	0.53
短期国庫債券					
JPY	690,000,000	JAPAN T-BILL 0% 06/02/17 642	6,608,688	5,894,672	2.19
			6,608,688	5,894,672	2.19
		合計: 日本	8,157,668	7,310,226	2.72
ルクセンブルグ					
ベイ・イン・カインド(PIK)債					
USD	200,000	ARD FIN SA PIK 7.125% 15/09/23 144A	199,000	197,500	0.07
EUR	100,000	ARD FIN SA PIK 6.625% 15/09/23 REGS	107,668	104,983	0.04
			306,668	302,483	0.11
ステップアップ/ダウン債					
USD	149,000	ARCELORMITTAL 7% 15/10/39	149,381	163,504	0.06
USD	25,000	ARCELORMITTAL STUP 25/02/22	23,563	28,297	0.01
			172,944	191,801	0.07
普通社債(固定金利債)					
EUR	800,000	EFSF 0.75% 05/06/17 EMTN	899,820	846,509	0.32
USD	1,600,000	INTELSAT LUX 8.125% 01/06/23	1,695,350	500,000	0.20
USD	414,000	WIND ACQUIS FIN 7.375% 23/04/21 144	404,931	430,560	0.16
USD	379,000	MALLINCKRODT INTL 4.75% 15/04/23	356,695	329,730	0.12
USD	380,000	INTEL JACKSON 7.25% 01/04/19	379,577	319,200	0.12
USD	222,000	WIND ACQUIS FIN 4.75% 15/07/20 144A	223,110	223,665	0.08
USD	201,000	ALTICE FINANCING 7.5% 15/05/26 144A	201,000	209,040	0.08
USD	214,000	MALLINCKRODT FIN 5.75% 1/8/22 144A	217,886	205,975	0.08
USD	200,000	ALTICE FIN SA 6.625% 15/02/23 144A	200,000	205,500	0.08
USD	200,000	COVERIS HDGS SA 7.875% 01/11/19 144	204,400	198,500	0.07
USD	125,000	CAMELOT FINANCE 7.875% 15/10/24 144	125,469	129,438	0.05
USD	75,000	MALLINCKRODT FIN 5.5% 15/04/25 144A	75,000	67,125	0.02
USD	37,000	INTELSAT JACK 8% 15/02/24 144A	37,000	38,018	0.01
USD	100,000	INTELSAT LUX 7.75% 01/06/21	36,300	32,750	0.01
USD	13,000	INTELSAT LUX 6.75% 01/06/18	7,296	10,530	0.00
USD	4,000	INTELSAT CONNECT 12.5% 1/04/22 144A	6,735	2,460	0.00
			5,070,569	3,749,000	1.40

通貨	数量/ 額面価格 ⁽¹⁾	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
短期国庫債券					
EUR	773,594	ESM TBILL 0% 12/01/17	868,093	814,102	0.30
			868,093	814,102	0.30
		合計: ルクセンブルグ	6,418,274	5,057,386	1.88
メキシコ					
国債					
MXN	150,000	MEXICAN BONOS DES 6.5% 9/06/22 M	1,118,652	699,737	0.26
MXN	107,600	MEXICAN BONOS DES 7.75% 13/11/42 M	855,577	514,957	0.19
MXN	90,000	MEXICAN BONOS DES 4.75% 14/06/18 M	664,958	422,718	0.16
MXN	60,000	MEXICAN BONOS DES 8.5% 31/5/29 M	533,837	308,927	0.11
MXN	25,000	MEXICAN BONOS DES 5.75% 05/03/26 M	110,503	107,365	0.04
			3,283,527	2,053,704	0.76
普通社債(固定金利債)					
USD	200,000	CEMEX SAB DE CV 5.7% 11/1/25 144A	199,999	202,906	0.08
USD	120,000	PEMEX 6.5% 13/03/27 144A	118,913	124,200	0.05
USD	10,000	PETROLEOS MEX 6.375% 04/02/21 REGS	11,075	10,650	0.00
USD	10,000	PETROLEOS MEX 5.5% 27/06/44	9,413	8,372	0.00
			339,400	346,128	0.13
		合計: メキシコ	3,622,927	2,399,832	0.89
オランダ					
変動金利債					
USD	600,000	ABN AMRO BK 6.25% 13/09/22 EMTN	655,860	613,504	0.23
USD	350,000	ING BANK NV FRN 21/11/23 EMTN	356,761	353,784	0.13
			1,012,621	967,288	0.36
国債					
EUR	300,000	NETHERLANDS GVT 1.75% 15/07/23	409,024	355,234	0.13
			409,024	355,234	0.13
普通社債(固定金利債)					
EUR	450,000	RABOBANK NED 3.875% 25/07/23	639,508	543,966	0.19
USD	375,000	CONSTELLIUM NV 5.75% 15/05/24 144A	312,188	350,624	0.13
USD	278,000	ZIGGO SEC 5.5% 15/01/27 144A	278,000	270,878	0.10
USD	250,000	LBC TANK TERM 6.875% 15/05/23 144A	263,750	255,853	0.10
USD	200,000	MARFRIG HLDG EUR 6.875% 24/6/19 14	203,500	205,000	0.08
USD	200,000	FIAT CHRYSLER AUTO 5.25% 15/04/23	199,250	203,660	0.08
USD	200,000	ZIGGO BONG FIN 5.875% 15/01/25 144A	200,000	200,000	0.07
EUR	100,000	BAYER CAP CORP 1.25% 13/11/23 EMTN	123,258	109,966	0.04
USD	85,000	MYLAN NV 3.95% 15/06/26 144A	84,346	79,390	0.03
USD	40,000	PETROBRAS GBL FIN 8.375% 23/05/21	39,601	43,200	0.02
USD	20,000	PETROBRAS GBL FIN 4.875% 17/03/20	18,466	19,774	0.01
			2,361,867	2,282,311	0.85
		合計: オランダ	3,783,512	3,604,833	1.34
ニュージーランド					
国債					
NZD	100,000	NEW ZEAL GVT 2.5% 20/09/35 CPI	81,271	71,270	0.03
			81,271	71,270	0.03
		合計: ニュージーランド	81,271	71,270	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(%)
ポーランド					
国債					
PLN	5,000,000	POLAND GVT BOND 5.75% 25/10/21 1021	1,566,192	1,340,876	0.50
PLN	2,500,000	POLAND GVT BOND 5.75% 23/09/22 0922	778,499	675,258	0.25
			<u>2,344,691</u>	<u>2,016,134</u>	<u>0.75</u>
		合計: ポーランド	<u>2,344,691</u>	<u>2,016,134</u>	<u>0.75</u>
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	10,000	0.00
			<u>15,040</u>	<u>10,000</u>	<u>0.00</u>
普通社債(固定金利債)					
USD	245,000	PUERTO RICO SALES FIRS 5.25% 1/8/41	163,846	115,150	0.05
USD	95,000	PUERTO RICO CMWL SERA 5.375% 1/7/33	74,456	58,900	0.03
USD	80,000	PUERTO RICO CMWLTH SERA 5.5% 1/7/26	65,300	50,000	0.03
USD	80,000	PUERTO RICO SALES TAX 5.375% 1/8/39	33,880	37,600	0.01
USD	270,000	PUERTO RICO SALES 0% 01/08/34	46,842	29,933	0.01
USD	55,000	PUERTO RICO SALES 5.5% 01/08/42	38,981	25,850	0.01
USD	35,000	PUERTO RICO CMWLTH IMP 5.75% 1/7/41	27,431	21,481	0.01
USD	45,000	PUERTO RICO SALES TAX 5.25% 1/08/27	34,998	21,150	0.01
USD	20,000	PUERTO RICO AQUE 5.25% 01/07/42	14,106	14,900	0.01
USD	25,000	PUERTO RICO SALES TAX 5.5% 01/08/37	20,442	11,750	0.00
USD	20,000	PUERTO RICO SALES 5% 01/08/43	9,546	9,400	0.00
USD	10,000	PUERTO RICO AQUE 5% 01/07/33	6,969	7,475	0.00
USD	15,000	PUERTO RICO SALES TAX 6% 01/08/39	12,480	7,275	0.00
USD	15,000	PUERTO RICO SALES TAX 5.75% 1/08/37	12,576	7,050	0.00
USD	15,000	PUERTO RICO SALES TAX 5% 01/08/35 C	11,464	7,050	0.00
USD	10,000	PUERTO RICO CMWLTH 5.5% 01/07/32	7,000	6,225	0.00
USD	10,000	PUERTO RICO SALES TAX 5.5% 01/08/28	7,813	4,700	0.00
USD	5,000	PUERTO RICO CMWLTH 5.5% 01/07/28	3,698	3,863	0.00
USD	5,000	PUERTO RICO SALES 5.25% 01/08/43	3,465	2,350	0.00
			<u>595,293</u>	<u>442,102</u>	<u>0.17</u>
		合計: プエルトリコ	<u>610,333</u>	<u>452,102</u>	<u>0.17</u>
韓国					
普通社債(固定金利債)					
USD	800,000	KOREA DEVEL BK 3% 14/09/22	794,056	805,750	0.30
USD	200,000	EXP-IMP BK KOREA 4% 29/01/21	212,391	209,204	0.08
			<u>1,006,447</u>	<u>1,014,954</u>	<u>0.38</u>
		合計: 韓国	<u>1,006,447</u>	<u>1,014,954</u>	<u>0.38</u>
シンガポール					
変動金利債					
USD	400,000	UTD OVERSEAS BK FRN 19/09/24 EMTN	403,064	407,999	0.15
USD	300,000	DBS BK SINGAPORE FRN 21/09/22 REGS	309,962	302,609	0.11
			<u>713,026</u>	<u>710,608</u>	<u>0.26</u>
国債					
SGD	750,000	SINGAPORE GVT 2.125% 01/06/26	565,810	503,233	0.19
			<u>565,810</u>	<u>503,233</u>	<u>0.19</u>
		合計: シンガポール	<u>1,278,836</u>	<u>1,213,841</u>	<u>0.45</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(%)
スロベニア					
国債					
EUR	1,000,000	REP OF SLOVENIA 2.25% 25/03/22	1,151,180	1,168,650	0.43
			<u>1,151,180</u>	<u>1,168,650</u>	<u>0.43</u>
		合計: スロベニア	<u>1,151,180</u>	<u>1,168,650</u>	<u>0.43</u>
南アフリカ					
国債					
ZAR	8,405,000	REP OF STH AFRICA 6.5% 28/2/41 R214	556,298	437,128	0.16
			<u>556,298</u>	<u>437,128</u>	<u>0.16</u>
		合計: 南アフリカ	<u>556,298</u>	<u>437,128</u>	<u>0.16</u>
スペイン					
普通社債(固定金利債)					
USD	200,000	ABENGOA GREENFIELD 6.5% 01/10/19 14	200,000	8,000	0.00
			<u>200,000</u>	<u>8,000</u>	<u>0.00</u>
		合計: スペイン	<u>200,000</u>	<u>8,000</u>	<u>0.00</u>
スウェーデン					
国債					
SEK	500,000	SWEDISH GVT 2.5% 12/05/25 1058	70,196	64,830	0.03
SEK	500,000	SWEDISH GVT 1.5% 13/11/23 1057	70,257	60,134	0.02
			<u>140,453</u>	<u>124,964</u>	<u>0.05</u>
普通社債(固定金利債)					
EUR	580,000	NORDEA HYPOTEK AB 3.5% 18/01/17 EMT	608,458	611,235	0.22
			<u>608,458</u>	<u>611,235</u>	<u>0.22</u>
		合計: スウェーデン	<u>748,911</u>	<u>736,199</u>	<u>0.27</u>
イギリス					
変動金利債					
USD	350,000	RBS FRN 29/03/49	370,750	324,016	0.11
USD	200,000	BARCLAYS BK PLC FRN 29/12/49	200,500	208,762	0.08
USD	200,000	LLOYDS BANKING GR FRN 30/04/49	193,000	205,866	0.08
USD	50,000	BARCLAYS PLC FRN 30/06/49	48,625	46,819	0.02
			<u>815,875</u>	<u>785,463</u>	<u>0.29</u>
国債					
GBP	10,000	UK TREAS GILT 3.25% 22/01/44	16,967	15,880	0.01
			<u>16,967</u>	<u>15,880</u>	<u>0.01</u>
普通社債(固定金利債)					
GBP	350,000	HSBC HLDGS PLC 6.75% 11/09/28	675,917	528,120	0.20
USD	430,000	INTL GAME 6.5% 15/02/25 144A	407,846	461,175	0.17
USD	300,000	BARCLAYS BANK PLC 7.625% 21/11/22	328,875	329,250	0.12
USD	200,000	VIRGIN MEDIA FIN 5.75% 15/01/25 144	201,688	199,270	0.07
USD	200,000	HSBC HDGS PLC 2.65% 05/01/22	199,812	195,062	0.07
EUR	100,000	LLOYDS BANK 1% 19/11/21 EMTN	123,706	108,682	0.04
USD	25,000	ENSCO PLC 5.75% 01/10/44	14,750	18,125	0.01
			<u>1,952,594</u>	<u>1,839,684</u>	<u>0.68</u>
		合計: イギリス	<u>2,785,436</u>	<u>2,641,027</u>	<u>0.98</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(%)
アメリカ					
資産担保証券					
USD	1,050,000	HLA 2015- 2A A CLO FRN 25/07/27	1,039,340	1,046,010	0.38
USD	1,000,000	ZCCP 2015 1A ACOM CLO FRN 16/07/27	983,336	991,701	0.36
USD	575,000	CHAIT 2016-A7 A7 1.06% 16/09/19	574,950	574,287	0.20
USD	500,000	APID 2012-10A A FRN 30/10/22	499,000	500,018	0.18
USD	500,000	OCF 2015-9A A1 CLO FRN 15/07/27	500,000	499,542	0.18
USD	440,000	POPLR 05-4 M1 FRN 25/09/35	379,500	403,240	0.15
USD	400,000	OFSBS 2013- 5A A2L CLO FRN 17/04/25	400,000	399,999	0.15
USD	465,000	GSAMP 06-HE1 M1 FRN 25/01/36	384,788	398,480	0.15
USD	440,000	CARR 05-NC5 M1 FRN 25/10/35	381,150	396,779	0.15
USD	425,000	RAMP 06 RZ1 M3 FRN 25/03/36	339,469	365,345	0.14
USD	350,000	NAVSL 2016-5A A 1.7374% 25/07/65	342,417	347,440	0.13
USD	300,000	MRAFT 2016-2 A FRN 10/03/19	300,000	300,000	0.11
USD	307,332	MSAC 05-HE3 M4 FRN 25/07/35	266,611	296,700	0.11
USD	285,000	SVHE 05-2 M5 FRN 25/07/35	252,225	269,346	0.10
USD	280,000	HASC 06-OPT2 M2 FRN 25/01/36	228,900	263,666	0.10
USD	250,000	PARL 15-1 A A FRN 20/07/27	249,350	249,752	0.09
USD	500,000	SLMA 03-1 A5A FRN 15/12/32	234,022	237,222	0.09
USD	250,000	SLMA 2007-1 A5 FRN 26/01/26	221,487	230,354	0.09
USD	250,000	RASC 05-KS12 M2 FRN 25/01/36	211,250	223,147	0.08
USD	1,000,000	ELAT 07-2 A2E FRN 25/05/37	191,760	213,433	0.08
USD	200,000	PHEAA 2016-1A A FRN 25/09/65	186,672	187,142	0.07
USD	200,000	SLMA 2008-5 A4 FRN 25/07/23	175,309	175,594	0.07
USD	150,000	NAVSL 2016-7A A FRN 25/03/66	148,203	149,715	0.06
USD	150,000	ECMC 2016-A1 A FRN 26/07/66	139,270	138,859	0.05
USD	150,000	FBRSI 05-2 M2 FRN 25/09/35	131,438	135,258	0.05
USD	200,000	HELT 2007-FRE1 2A FRN 25/04/37	122,000	131,822	0.05
USD	150,000	JPMAC 07-CH2 A5V FRN 25/01/37	117,281	129,176	0.05
USD	230,000	SVHE 07-1 2A3 FRN 25/03/37	116,924	121,376	0.05
USD	150,000	GSAMP 06-HE8 A2C FRN 25/01/37	111,084	110,171	0.04
USD	120,000	AMIT 2005-4 M3 FRN 25/10/35	96,600	107,094	0.04
USD	250,000	FCLO 6A A CLO FRN 09/08/19	96,990	99,974	0.04
USD	100,000	SLMA 08-4 A4 FRN 25/07/22	95,328	95,082	0.04
USD	510,000	HEMT 04-5 M2 FRN 25/02/35	93,885	94,722	0.04
USD	100,000	NAVSL 2016-6A A1 1% 25/03/66	92,140	92,155	0.03
USD	100,000	JPMAC 06-CHI M1 FRN 25/07/36	82,000	91,759	0.03
USD	100,000	CARR 06-RFC1 A4 FRN 25/05/36	80,375	87,312	0.03
USD	100,000	SLMA 05-4 A3 FRN 25/01/27	74,597	77,485	0.03
USD	200,000	NSLT 2005-4 A3 FRN 22/06/26	76,088	76,787	0.03
USD	200,000	ACE 06-ASP4 A2C FRN 25/08/36	66,794	76,011	0.03
USD	80,000	GSA A 2005-10 M4 FRN 25/06/35	71,500	74,088	0.03
USD	110,000	CARR 2005-NC1 M3 FRN 25/02/35	68,993	73,115	0.03
USD	100,000	SLMA 08-2 A3 FRN 25/04/23	71,462	72,156	0.03
USD	110,000	VOLT 15-NPL8 A1 3.5% 26/06/45	69,596	69,700	0.03
USD	200,000	SCHOL 10-A A FRN 28/10/41	68,393	69,178	0.03
USD	270,000	PPS1 04-WHQ1 M4 FRN 25/09/34	51,366	52,205	0.02
USD	100,000	HEF 2005-1 A4 FRN 25/02/30	43,013	43,509	0.02
USD	100,000	SLMA 2003-14 A5 FRN 25/01/23	27,294	27,541	0.01
USD	150,000	ACCS 2006-1 A2 FRN 25/08/23	11,068	11,181	0.00
			10,565,218	10,876,628	4.05
バンクローン					
USD	2,538,125	TIBCO SOFTWARE FRN 25/11/20 TL	2,441,615	2,553,467	0.96
USD	2,150,000	CLEAR CHANNEL COM FRN 30/07/19 TE01	2,140,875	1,749,562	0.66
USD	1,514,310	ALBERTSONS LLC FRN 25/08/21 TL B4	1,506,151	1,534,343	0.58
USD	1,513,184	CERIDIAN CORP FRN 15/9/20 REPS1STTL	1,508,698	1,506,873	0.57
USD	1,274,565	ADVANTAGE FRN 23/07/21 1STINIT TL	1,255,523	1,281,256	0.49
USD	1,136,704	TRAVEL PORT FRN 15/08/21 TL01	1,123,934	1,150,025	0.44
USD	1,109,849	DELL INTL FRN 02/06/23 TLB	1,111,800	1,130,353	0.42

通貨	数量/ 額面価格 ⁽¹⁾	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
USD	1,120,500	KINETIC CONCEPTS FRN 4/5/18 \$ TE1	1,116,298	1,125,518	0.42
USD	1,090,282	GATES GLOBAL FRN 12/6/21 INIT\$ TL01	1,077,257	1,092,723	0.41
USD	1,037,227	LIFE TIME FRN 10/6/22 CLOSDATE TL	1,032,041	1,045,747	0.39
USD	1,000,000	ZIGGO BV FRN 31/08/24 USD TD01	980,500	1,009,509	0.38
USD	1,001,096	ENERGY FUTURE FRN 30/06/17 DIP TL	1,002,310	1,008,478	0.38
USD	978,725	GO DADDY OPER FRN 13/05/21 INITL	972,916	990,591	0.37
USD	990,000	INFORMATICA DOLLAR FRN 30/6/22 TL	987,525	987,628	0.37
USD	982,513	GOBP/GROCERY FRN 21/10/21 1STINITL	975,205	983,740	0.37
USD	981,913	AMERICAN TIRE FRN 24/9/21 INIT TL	977,003	980,891	0.36
USD	956,866	EQUINOX HLDG FRN 31/01/20 NEW TB01	955,180	968,229	0.36
USD	985,416	ACOSTA INC FRN 26/09/21 INIT TL	981,701	963,555	0.36
USD	942,155	INFOR US FRN 03/06/20 TB501	927,490	945,000	0.35
USD	932,953	FIRST DATA CORP FRN 10/07/22 USD TL	928,289	944,265	0.35
USD	978,194	SEARS HLDG FRN 30/06/18 TL01	954,286	940,900	0.35
USD	925,000	EYEMART EXP LLC FRN 16/12/21 TL	920,375	927,313	0.35
USD	918,369	PETCO ANIMAL SUP FRN 26/01/23 TLB1	897,768	924,302	0.34
USD	886,875	COMPWARE CORP FRN 11/12/21 TB201	842,531	893,637	0.33
USD	855,743	ZEBRA TECHNO FRN INIT 27/10/21 TL01	849,325	866,842	0.32
USD	836,894	COMMUNICATIONS SAL FRN 24/10/22 TL1	820,156	849,238	0.32
USD	834,733	NATIONAL FIN PART FRN 01/07/20 TL	830,683	843,602	0.31
USD	826,653	BJS WHOLESALE FRN 26/9/19 1ST TL	818,168	835,879	0.31
USD	755,578	US FOODS FRN 15/06/23 INTL TL	753,689	764,630	0.28
USD	750,000	LEVEL 3 FIN FRN 31/05/22 TB	744,375	760,155	0.28
USD	750,000	RITE AID CORP FRN 21/8/20 2ND TL1	752,813	756,716	0.28
USD	750,000	DELOS INTL LEASE FRN 27/02/21 TL	746,250	756,428	0.28
USD	734,962	ATKORE INTL FRN 15/12/23 1ST TL	731,288	742,312	0.28
USD	736,875	PRO MACH GRP FRN 15/10/21 1ST \$ TL	729,506	737,428	0.27
USD	723,621	FITNESS INT FRN 01/07/20 TL B	719,399	725,658	0.27
USD	723,067	VALEANT FRN 05/08/20 E1 TB TL01	720,657	722,514	0.27
USD	708,235	SIG COMBIBLOC FRN 03/02/22 \$ TL01	704,694	715,098	0.27
USD	693,840	MICRO HLDG FRN 08/07/21 INIT 1STL01	690,758	698,829	0.26
USD	666,368	ZAYO GROUP LLC FRN 02/07/19 TB	660,815	674,604	0.25
USD	642,543	WARNER MUSI/WMG ACQ FRN 1/7/20 TC	620,722	649,450	0.24
USD	639,124	CATALENT PHARMA FRN 20/05/21 \$ TL	639,124	645,001	0.24
USD	663,293	YORK RISK SVC FRN 1/10/21 INIT TL	657,812	630,957	0.23
USD	632,602	CENGAGE LEARN FRN 07/06/23 TLB	628,570	617,354	0.23
USD	641,511	OPAL ACQ FRN 21/11/20 1ST TB	640,416	614,247	0.23
USD	602,499	CITYCENTER HDGS FRN 09/10/20 TB01	603,252	610,533	0.23
USD	600,000	SAFEWAY GROUP FRN 04/08/23 TL	594,500	609,624	0.23
USD	617,063	CARECORE NTL INIT FRN 05/03/21 TL01	612,435	608,579	0.23
USD	594,000	NAVISTAR INTL FRN 17/08/17 TB	585,090	602,316	0.22
USD	568,161	EP ENERGY FRN 30/06/21 TL	559,011	595,859	0.22
USD	588,136	PRESTIGE BRANDS FRN 03/09/21 TB03	585,196	593,724	0.22
USD	567,725	BLACKBOARD FRN 30/06/21 TL B 01	569,480	573,050	0.21
USD	503,317	AVAGO TECHNO FRN 01/02/23 TB301	499,279	511,181	0.19
USD	500,000	GREENEDEN FRN 17/11/23 INIT \$ TL	492,500	509,845	0.19
USD	509,732	BMC INIT FRN 10/09/20 USD TL01	505,973	508,840	0.19
USD	500,000	LEVEL 3 FIN FRN 1/8/19 TLB3	498,125	507,625	0.19
USD	500,000	ON SEMI 2016 NEW PEP FRN 31/3/23 TL	492,500	507,275	0.19
USD	500,000	RACKSPACE HOS FRN 26/10/23 TB	497,500	507,240	0.19
USD	500,000	DYNEGY FIN IV ESC FRN 27/06/23 TL	495,000	507,188	0.19
USD	499,696	FIRST DATA FRN 24/03/21 EXT USD TL	495,863	506,115	0.19
USD	500,000	ANCESTRY FRN 14/10/23 1ST TL	497,500	506,093	0.19
USD	498,750	PQ CORPORATION FRN 04/11/22 TB1	503,114	506,077	0.19
USD	500,000	ALPHA TOPCO/DELTA FRN 30/7/21 TB301	496,875	505,820	0.19
USD	498,724	MACOM TECHNO FRN 7/05/21 INIT TL	493,987	505,582	0.19
USD	500,000	ALPHA TOPC FRN 29/7/22 2ND FAC TL01	501,875	505,000	0.19
USD	497,500	NUMERICABLE USD FRN 08/01/24 TB701	492,525	504,920	0.19
USD	500,000	DIGITALGLOBE FRN 22/12/23 TL	498,750	504,375	0.19
USD	500,000	UBER TECHNO FRN 07/07/23 TL	490,000	501,875	0.19

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	497,475	PETSMART FRN 11/03/22 TB 201	496,853	499,567	0.19
USD	490,000	AMERICAN AIRLINES 15 FRN 12/10/21 TB	486,325	493,790	0.18
USD	488,726	TRANS UNION FRN 09/04/21 TB201	482,616	493,789	0.18
USD	490,009	AMERICAN AIRLINE B FRN 27/6/19 TL01	486,334	493,295	0.18
USD	488,750	DPX HLDS INCREM FRN 11/03/21 USD TL	483,863	493,129	0.18
USD	488,665	USI COMPASS INVEST FRN 27/12/19 TL	482,557	492,147	0.18
USD	491,250	BASS PRO GROUP FRN 05/06/20 TL	490,022	490,712	0.18
USD	487,179	UNIVISION FRN 01/03/20 INC2013 TL01	483,525	490,579	0.18
USD	481,955	DAVITA HEALTHCARE FRN 02/06/21 TB	480,148	487,618	0.18
USD	714,636	CUMULUS MEDIA FRN 19/12/20 TL01	707,453	484,759	0.18
USD	465,417	BURLINGTON COAT FRN 13/08/21 TB401	461,926	469,571	0.17
USD	459,091	U NEXSTAR BROADCAST FRN 26/9/23 TB	457,943	463,753	0.17
USD	455,332	BERRY PLASTICS FRN 06/01/21 TLG	446,226	458,938	0.17
USD	454,545	TRANSDIGM INC FRN 21/05/21 TD	450,000	458,593	0.17
USD	447,857	TEX OPER COMP FRN 04/08/23 TL01	443,379	453,874	0.17
USD	428,084	STERIGENICS NORD FRN 16/5/22 INITL	427,013	431,029	0.16
USD	487,437	NEIMAN MARCUS FRN 25/10/20 TL01	483,781	425,167	0.16
USD	409,515	CCM MERGER FRN 08/08/21 TLB	407,468	414,634	0.15
USD	430,664	OPAL ACQ FRN 21/11/20 1ST TB02	429,929	412,361	0.15
USD	404,065	BERLIN PACK FRN 1/10/21 1ST INTL01	403,283	408,136	0.15
USD	405,505	INEOS FRN 04/05/18 DOLLAR TL01	402,464	407,300	0.15
USD	403,782	LTS BUYER FRN 13/04/20 1ST TLB	402,622	407,062	0.15
USD	403,993	U VIRGIN MEDIA BRIS FRN 31/1/25 FAC	402,983	406,417	0.15
USD	398,750	DIEBOLD INC FRN 05/04/23 DOL TB01	400,245	405,479	0.15
USD	391,995	UNIVISION REPLA FRN 01/3/20 1STL01	389,794	394,731	0.15
USD	387,522	RBS GLOBAL FRN 21/08/23 TB01	384,615	389,750	0.15
USD	376,748	TTM TECHNOLOGIE FRN 07/05/21 TB	361,586	382,399	0.14
USD	361,687	RBS GLOBAL FRN 21/08/23 TB02	358,974	363,767	0.14
USD	356,653	CAPITAL AUTOMOT FRN 19/03/19 TB101	356,207	360,833	0.13
USD	354,643	HILTON WORLW FRN 26/10/20 INTLB201	353,313	358,356	0.13
USD	342,965	LINEAGE LOGIST FRN 07/04/21 TL	339,535	341,250	0.13
USD	331,053	COTIVITI CORP FRN 22/09/23 TB	329,958	334,640	0.12
USD	328,947	CSC HOLDING FRN 11/10/24 TL B01	326,480	333,059	0.12
USD	299,057	MINERALS TECHNO FRN 31/05/21 TB2	298,309	303,169	0.11
USD	297,750	ENDO 15 FRN 24/06/22 INCR TB01	297,006	299,665	0.11
USD	289,768	VALEANT PHAR FRN 13/2/19 1L D2 TB	286,379	290,058	0.11
USD	327,624	AVAYA FRN 30/03/18 TB601	328,443	286,507	0.11
USD	286,338	BASS PRO GP FRN 01/04/24 INITL02	283,475	284,038	0.11
USD	271,795	PRISO ACQ FRN 01/05/22 INITIAL TL	270,436	274,343	0.10
USD	268,219	PARTY CITY FRN 19/08/22 TL04	267,548	271,117	0.10
USD	260,648	BERLIN PACK FRN 1/10/21 1ST INTL02	260,144	263,274	0.10
USD	250,000	CAPITAL AUTOMOTIVE 30/4/20 2ND TL01	250,000	253,958	0.09
USD	250,000	ABACUS INNOV FRN 09/06/23 TLB	249,375	252,858	0.09
USD	247,725	COTIVITI CORP FRN 22/09/23 TB02	246,906	250,409	0.09
USD	246,915	POWER BUYER FRN 06/05/20 1STL01	242,594	247,687	0.09
USD	243,251	RIVERBED TECHNO FRN 24/04/22 TL	242,034	245,345	0.09
USD	248,386	QUORUM HEALTH FRN 12/04/22 TL02	247,710	244,142	0.09
USD	240,000	DOLLAR TREE FRN 26/05/22 TB2	240,000	244,099	0.09
USD	223,360	IMG WORLDWIDE FRN 06/05/21 1ST TL01	220,568	226,153	0.08
USD	220,165	AMWINS GROUP FRN 06/09/19 1ST TL02	220,109	222,889	0.08
USD	214,485	SABRE FRN 18/02/19 TB02	213,144	217,188	0.08
USD	216,216	DELL INTL FRN 31/12/19 TLA1	215,676	216,303	0.08
USD	213,662	BASS PRO GP FRN 01/04/24 INITL01	211,525	211,945	0.08
USD	203,844	UNIVAR USA FRN 01/7/22 INIT \$ TL01	202,825	206,094	0.08
USD	203,826	SUPERVALU FRN 21/03/19 TL02	202,616	205,586	0.08
USD	199,767	UNIVAR USA FRN 01/07/22 INIT \$ TL02	198,768	201,972	0.08
USD	195,993	ASURION FRN 29/07/22 INCREM 1ST TB4	194,394	198,860	0.07
USD	195,466	SCIENTIFIC GAME FRN 18/10/20 B1 TL1	192,045	198,276	0.07
USD	196,931	CCC INFO SYST FRN 20/12/19 TL	196,685	197,546	0.07
USD	191,863	SABRE FRN 18/02/19 TB	190,664	194,281	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	191,606	AMWINS GROUP FRN 06/09/19 1ST TL01	191,558	193,978	0.07
USD	189,000	SGMS ESCROW CORP FRN 01/10/21 TB202	185,456	191,684	0.07
USD	152,394	SUPERVALU FRN 21/03/19 TL	151,489	153,710	0.06
USD	148,875	PETCO ANIMAL SUPP FRN 26/01/23 TB2	145,153	149,936	0.06
USD	147,144	ADVANCEPIERRE FOOD FRN 26/5/23 TL	146,409	149,697	0.06
USD	132,804	BURGER KING/TIM FRN 10/12/21 TL B2	132,472	134,174	0.05
USD	127,500	MA FINANCE/MICRO 7/10/19 INITC TL01	121,125	129,273	0.05
USD	127,778	REVLON CONSUM FRN 07/09/23 INITTB01	127,139	129,259	0.05
USD	125,085	ALERE FRN 03/06/22 TB	124,772	125,259	0.05
USD	119,939	BE AEROSPACE FRN 19/11/21 TL03	119,340	120,764	0.04
USD	119,939	BE AEROSPACE FRN 19/11/21 TL02	119,340	120,764	0.04
USD	119,939	BE AEROSPACE FRN 19/11/21 TL01	119,340	120,764	0.04
USD	116,958	DOLLAR TREE FRN 06/07/22 INIT TB3	116,483	118,237	0.04
USD	116,371	JAGUAR HDG CIE II FRN 18/08/22 TL01	115,762	117,826	0.04
USD	115,000	CORTES NP ACQ FRN 29/09/23 INT TL	111,550	116,438	0.04
USD	113,179	PARTY CITY FRN 19/08/22 TL02	112,896	114,402	0.04
USD	105,000	SGMS ESCROW FRN 01/10/21 TB201	103,031	106,491	0.04
USD	102,143	TEX OPER COMP FRN 04/08/23 TL02	101,121	103,515	0.04
USD	100,000	LONESTAR INTER HDG FRN 10/8/21 TL	99,000	103,250	0.04
USD	99,750	KFC HOLDING FRN 06/02/23 TLB	99,251	101,355	0.04
USD	96,340	JAGUAR HDG CIE II FRN 18/08/22 TL02	95,836	97,545	0.04
USD	95,677	MPH ACQ FRN 25/05/23 INIT TL	95,199	97,506	0.04
USD	95,101	LA QUINTA PROP FRN 14/04/21 INITL	94,269	95,295	0.04
USD	88,110	INEOS US FRN 12/03/22 USD TERM	87,669	89,356	0.03
USD	86,926	CITGO PETROLEUM FRN 09/0518 TL01	87,578	88,411	0.03
USD	86,735	MA FINANCE/MICRO FRN 19/11/21 TB201	82,832	88,006	0.03
USD	166,799	NEW MILLENIUM HOLD FRN 21/12/20 TL	408,422	85,624	0.03
USD	80,798	RBS GLOBAL FRN 21/08/23 TB03	80,192	81,263	0.03
USD	79,765	SIG COMBIBLOC FRN 03/02/22 \$ TL02	79,366	80,538	0.03
USD	76,000	KRONOS INC FRN 20/10/24 TB	75,240	77,069	0.03
USD	75,000	U MOHEGAN TRIBAL GAM FRN 30/9/23 TB	74,250	75,774	0.03
USD	75,000	LIONS GATE ENT FRN 08/12/23 TB	74,625	75,625	0.03
USD	74,049	THE CHEMOURS CO FRN 07/05/22 TLB	73,679	73,865	0.03
USD	87,866	HERCULES OFF FRN 14/1/19 1ST TL	53,050	70,146	0.03
USD	71,707	YORK RISK SVC FRN 1/10/21 INIT TL2	71,115	68,212	0.03
USD	76,419	GETTY IMAGES FRN 18/10/19 INIT TL01	63,135	66,930	0.02
USD	63,889	REVLON CONSUM FRN 07/09/23 INITTB03	63,569	64,630	0.02
USD	63,889	REVLON CONSUM FRN 07/09/23 INITTB04	63,569	64,630	0.02
USD	63,889	REVLON CONSUM FRN 07/09/23 INITTB05	63,569	64,630	0.02
USD	63,889	REVLON CONSUM FRN 07/09/23 INITTB07	63,569	64,630	0.02
USD	63,889	REVLON CONSUM FRN 07/09/23 INITTB02	63,569	64,630	0.02
USD	63,889	REVLON CONSUM FRN 07/09/23 INITTB06	63,569	64,630	0.02
USD	63,889	REVLON CONSUM FRN 07/09/23 INITTB08	63,569	64,630	0.02
USD	58,500	U LIONS GATE ENTERT FRN 08/02/17 TL	58,500	58,500	0.02
USD	50,000	CHESAPEAKE NRJ FRN 23/8/21 CLA TL	50,000	54,563	0.02
USD	50,000	ANCESTRY FRN 14/10/24 2ND LIEN TL	49,500	51,250	0.02
USD	50,000	ASURION FRN 03/03/21 2ND TL01	48,625	50,922	0.02
USD	50,000	SERTA SIMM FRN 21/10/24 2ND INIT TL	49,250	50,417	0.02
USD	49,375	21ST CENT ONC FRN 14/04/22 TB	48,881	45,672	0.02
USD	46,331	DRUMM INVEST FRN 04/05/18 TL01	46,679	45,462	0.02
USD	40,909	U MISSION BROAD FRN 26/09/23 TB	40,807	41,325	0.02
USD	125,000	TEXAS COMP EXT FRN 10/10/17 TL01	76,563	36,510	0.01
USD	34,205	TRANSDIGM INC FRN 21/05/21 TD02	33,863	34,509	0.01
USD	33,485	POWER BUYER FRN 06/05/20 1STL02	32,899	33,590	0.01
USD	29,000	CAMELOT FRN 16/09/23 INITIAL TL02	28,855	29,393	0.01
USD	50,000	AMERICAN NRG FRN 4/8/20 INIT 1STL	43,500	27,667	0.01
USD	25,000	U MULTIPLAN FRN 25/05/23 TL B	25,344	25,478	0.01
USD	25,000	ASURION FRN 3/11/23 INCREM 1ST TB5	24,875	25,388	0.01
USD	24,938	WESTERN DIGIT FRN 29/04/23 TLB	24,938	25,374	0.01
USD	25,000	U UFC FRN 18/08/23 TL	25,188	25,363	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	U SCIENTIFIC GAME FRN 18/10/20 TL	25,375	25,359	0.01
USD	25,000	FORTERRA FIN SENIOR FRN 20/10/23 TL	24,875	25,338	0.01
USD	25,000	RP CROWN FRN 21/09/23 INITL	24,875	25,328	0.01
USD	25,000	DONNELLEY FIN FRN 27/09/23 TB	24,875	25,302	0.01
USD	24,750	PINNACLE FOOD 4TH AM FRN 13/1/23 TI	24,626	25,188	0.01
USD	25,000	CALPINE CORPORATION FRN 03/11/17 TL	24,750	25,125	0.01
USD	24,747	RHP HOTEL PROP FRN 15/01/21 TB01	24,809	25,072	0.01
USD	21,815	DTZ FRN 04/11/21 INIT 1ST TL07	21,706	21,946	0.01
USD	21,000	CAMELOT FRN 16/09/23 INITIAL TL01	20,895	21,284	0.01
USD	20,722	PARTY CITY FRN 19/08/22 TL03	20,670	20,946	0.01
USD	20,390	IMG WORLDWIDE FRN 06/05/21 1ST TL02	20,135	20,645	0.01
USD	19,880	AVAYA FRN 30/04/20 TB701	13,817	17,326	0.01
USD	16,500	U LIONS GATE ENTERT FRN 05/02/17 TL	16,500	16,500	0.01
USD	16,078	ADVANTAGE FRN 23/07/21 1STINIT TL02	15,838	16,163	0.01
USD	13,904	ENERGY FUTURE FRN 30/06/17 DIP TL02	13,921	14,007	0.01
USD	13,831	POWER BUYER FRN 06/05/20 1STL03	13,589	13,874	0.01
USD	13,171	HILTON WORLWIDE FRN 23/9/20 INITL02	13,121	13,309	0.00
USD	12,913	HILTON WORLWIDE FRN 26/10/20 INTL01	12,865	13,049	0.00
USD	11,725	MAGNUM HUNT RES FRN 15/04/19 TL01	11,255	11,784	0.00
USD	11,581	CERIDIAN REP US FRN 15/9/20 1STTL03	11,546	11,532	0.00
USD	9,775	PARTY CITY FRN 19/08/22 TL01	9,750	9,880	0.00
USD	9,309	DTZ FRN 04/11/21 INIT 1ST TL01	9,262	9,365	0.00
USD	3,301	ADVANTAGE FRN 23/07/21 1STINIT TL03	3,252	3,318	0.00
USD	2,633	LIFE TIME FRN 10/6/22 CLOSDATE TL06	2,619	2,654	0.00
USD	1,659	DTZ FRN 04/11/21 INIT 1ST TL10	1,650	1,668	0.00
USD	1,589	CENGAGE LEARN FRN 07/06/23 TLB02	1,579	1,551	0.00
USD	1,250	DIEBOLD INC FRN 06/11/23 DOL TB02	1,255	1,271	0.00
USD	1,250	BASS PRO GROUP FRN 05/06/20 TL07	1,247	1,249	0.00
USD	1,256	NEIMAN MARCUS FRN 25/10/20 TL13	1,247	1,096	0.00
USD	891	HILTON WORLW FRN 25/10/23 INITTB206	888	903	0.00
USD	750	SGMS ESCROW CORP FRN 01/10/21 TB207	736	761	0.00
USD	573	IMG WORLDWIDE FRN 06/05/21 1ST TL18	566	580	0.00
USD	532	DTZ 2015 1 FRN 04/11/21 TL02	529	535	0.00
USD	504	SCIENTIFIC GAME FRN 18/10/20 B1 TL9	495	511	0.00
USD	83	DTZ 2015 1 FRN 04/11/21 TL09	83	84	0.00
USD	52	IMG WORLDWIDE FRN 06/05/21 1ST TL19	52	53	0.00
USD	32	DTZ 2015 1FRN 04/11/21 TL08	32	32	0.00
			80,613,298	80,702,151	30.03

モーゲージ担保証券

USD	400,000	MABS 05-HE2 M2 FRN 25/10/35	351,000	366,452	0.13
USD	300,000	MRAFT 2016-1 A FRN 10/09/18	300,000	300,000	0.11
USD	600,000	DBALT 07-OA3 A1 FRN 25/07/47	192,928	186,877	0.07
USD	5,025,000	GNR 10-20 SE IO FRN 20/02/40	167,502	176,870	0.07
USD	650,000	LXS 06-16N A4A FRN 25/11/46	162,799	165,794	0.06
USD	2,000,000	GNR 2014-20 SA IO FRN 20/02/44	150,103	164,632	0.06
USD	2,000,000	FNR 13-121 SA IO FRN 25/12/43	141,553	140,656	0.05
USD	400,000	BSMF 07-AR5 2A1 FRN 25/06/37	134,466	133,418	0.05
USD	2,500,000	GNR 10-101 S IO FRN 20/08/40	116,824	106,759	0.04
USD	400,000	AHMA 06-2 1A1 FRN 25/09/46	107,507	102,974	0.04
USD	1,059,596	GNR 15-110 IO FRN 20/08/45	112,908	102,923	0.04
USD	570,000	LXS 05-7N 1A1A FRN 25/12/35	89,920	91,242	0.03
USD	185,000	JPALT 07-A2 12A3 FRN 25/06/37	80,658	83,163	0.03
USD	1,000,000	GNR 2015-57 AS IO FRN 20/04/45	78,932	82,573	0.03
USD	300,000	SAMI 05-AR7 5A1 FRN 25/03/46	81,323	79,942	0.03
USD	200,000	IMSA 07-1 A2 FRN 25/03/37	76,147	79,756	0.03
USD	1,000,000	GNR 13-181 SA IO FRN 20/11/43	70,547	74,512	0.03
USD	750,000	FNR 15-81 SA IO FRN 25/11/45	71,043	68,482	0.03
USD	100,000	LSTRZ 2015-3 A FRN 01/03/20	66,506	67,291	0.03
USD	400,000	LUM 06-7 1A1 FRN 25/12/36	63,047	65,541	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	500,000	G2SF 4 2015-159 HS IO FRN 20/11/45	60,594	62,486	0.02
USD	500,000	FNR 15-82 MS IO FRN 25/11/45	56,767	61,679	0.02
USD	525,000	FNR 14-87 IO FRN 25/01/45	53,318	51,388	0.02
USD	800,000	IMJA 07-A1 A3 6% 25/08/37	53,139	50,782	0.02
USD	200,000	LXS 06-14N 1A1A FRN 25/09/46	47,160	48,170	0.02
USD	500,000	G2SF 5 2012-149 MS IO FRN 20/12/42	27,461	28,586	0.01
USD	775,000	GNR 10-31 SA IO FRN 20/03/40	26,446	28,273	0.01
USD	250,000	GNR 14-41 SA IO FRN 20/03/44	19,983	22,443	0.01
USD	250,000	GNR 2013-134 DS IO FRN 20/09/43	17,464	18,666	0.01
USD	250,000	FHR 4320 SD IO FRN 15/07/39	19,017	18,596	0.01
			2,997,062	3,030,926	1.13
商業不動産担保証券					
USD	1,100,000	FHMS K044 A2 2.811% 25/01/25	1,132,976	1,099,145	0.42
USD	2,400,000	WFRBS 14-C21 XA IO 1.36% 15/08/47	192,687	139,457	0.05
USD	1,750,000	UBSBB 12-C4 XA IO FRN 10/12/45	172,408	117,327	0.04
USD	2,150,000	CGCMT 13-GC15 XA IO FRN 10/09/46	141,743	89,957	0.03
USD	1,000,000	CGCMT 15-GC27 XA IO FRN 10/02/48	105,766	82,072	0.03
USD	1,500,000	WFRBS 14-C22 XA IO 0.971% 15/09/57	96,411	71,568	0.03
USD	1,300,000	GSMS 15-GC30 XA IO FRN 10/05/50	79,455	63,972	0.02
			1,921,446	1,663,498	0.62
変動金利債					
USD	493,000	GOLDMAN SACHS FRN 29/12/49 L	501,395	507,257	0.19
USD	454,000	LINCOLN NATL CORP FRN 17/05/66	460,780	367,739	0.14
USD	335,000	BANK OF AMERICA CORP FRN 29/07/49 K	362,705	344,212	0.13
USD	250,000	JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/01/49	264,375	270,767	0.10
USD	255,000	CITIGROUP INC FRN 29/12/49 M	252,086	252,832	0.09
USD	188,000	JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/04/49 1	206,565	194,673	0.07
USD	185,000	ILFC E CAP TRUST I FRN 21/12/65 144	177,600	162,338	0.06
USD	150,000	BANK OF AMERICA CORP FRN 23/10/49 Z	150,875	157,751	0.06
USD	142,000	MORGAN STANLEY FRN 29/12/49	142,000	143,714	0.05
USD	138,000	MORGAN STANLEY FRN 29/07/49 H	137,160	137,331	0.05
USD	141,000	ILFC E-CAP TR II FRN 21/12/65 144A	137,475	124,080	0.05
USD	100,000	BANK OF AMERICA CORP FRN 29/09/49 X	99,938	100,625	0.04
USD	100,000	PNC PFD FDING TR FRN 29/03/49 144a	97,750	96,500	0.04
USD	90,000	JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/12/49 R	91,908	90,463	0.03
USD	85,000	CAPITAL ONE FINCL CO FRN 29/12/49 E	85,000	86,063	0.03
USD	75,000	JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/12/49 U	75,188	76,172	0.03
USD	75,000	ENTREPRISE PRODUCTS FRN 01/08/66 A	76,688	70,540	0.03
USD	70,000	AMERICAN EXPRESS FRN 29/12/49	70,000	66,413	0.02
USD	65,000	VOYA FINANCIAL INC FRN 15/05/53	66,491	63,863	0.02
USD	60,000	PRUDENTIAL FIN FRN 5.2% 15/03/44	60,512	59,290	0.02
USD	50,000	CITIGROUP INC FRN 29/12/49 Q	50,000	50,746	0.02
USD	50,000	GOLDMAN SACHS FRN 31/12/49 M	50,219	50,500	0.02
USD	39,000	GOLDMAN SACHS CAP II FRN 01/12/49	30,018	31,828	0.01
USD	25,000	BANK OF AMERICA FRN 29/12/49 DD	25,000	26,125	0.01
USD	25,000	CITIGROUP INC FRN 29/12/49 T	25,000	25,725	0.01
USD	25,000	JPMORGAN CHASE CO FRN 29/12/49 V	24,625	25,019	0.01
			3,721,353	3,582,566	1.33
投資信託					
--	23,700	ISHARES IBOX USD H/Y CORP BOND ETF	2,119,320	2,052,421	0.76
--	56,070	SPDR BLOOMBERG BARCLAYS H/Y BD ETF	2,076,431	2,044,032	0.76
--	55,294	POWERSHARES SENIOR LOAN ETF	1,292,758	1,291,944	0.48
--	6,570	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING ETF	748,230	725,459	0.27
			6,236,739	6,113,856	2.27

通貨	数量/ 額面価格 ⁽¹⁾	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
普通株式					
--	4,875	UCI HOLDINGS INC COMMON STOCK	77,406	143,812	0.06
--	10,628	DENBURY RESOURCES INC	25,937	40,227	0.02
--	2,148	HALCON RESOURCES CORP	72,714	20,084	0.01
--	6,086	NII HOLDINGS INC	123,841	13,085	0.00
--	5,054	NEW MILLENIUM HOLDCO INC COM	81,777	8,847	0.00
--	5,174	HERCULES OFFSHORE INC ESC	298,352	5,847	0.00
--	160	MIDSTATES PETROLEUM CO INC	152,597	3,280	0.00
			832,624	235,182	0.09
その他債券					
USD	366,000	GLEN MEADOW FRN 12/02/67 144A	337,386	282,734	0.10
USD	570,801	IHEART COMM INC PIK 14% 01/02/21	523,125	217,618	0.08
USD	200,000	RED OAK POWER 9.2% 30/11/29 B	212,875	208,500	0.08
USD	435,000	ELWOOD ENERGY 8.159% 05/07/26	184,118	183,709	0.07
USD	200,000	AMER AIRL 13-2 B PT 5.6% 15/7/20 14	161,660	163,632	0.06
USD	400,000	HOMER CITY GEN PIK 8.637% 01/10/19	309,122	127,689	0.05
USD	110,000	AMER AIRLINES 14-1 B 4.375% 1/10/22	92,382	90,350	0.03
USD	185,000	HOMER CITY GEN PIK 8.734% 01/10/26	173,469	72,984	0.03
USD	50,000	CONTL AIRLINES 6.125% 29/04/18 12-3	52,688	51,938	0.02
USD	9,000	US AIRWAYS 6.75% 2012-2B 03/12/22	7,903	8,042	0.00
USD	570,801	IHEART COMM INC PIK 14% 1/2/21 ESC	0	1,027	0.00
			2,054,728	1,408,223	0.52
ペイ・イン・カインド(PIK)債					
USD	75,000	INFOR SOFT PIK 7.125% 01/05/21 144A	73,656	77,250	0.03
USD	15,189	NEW DAY ALU PIK 10% 28/10/20	0	0	0.00
			73,656	77,250	0.03
ステップアップ/ダウン債					
USD	300,000	SABINE PASS LIQ 5.625% 15/04/23	284,208	319,652	0.11
USD	205,000	HP ENTERPRISE CO 4.4% 15/10/22 144A	216,671	213,249	0.08
USD	184,000	TERRAFORM GLOBAL 9.75% 15/08/22 144	177,830	196,420	0.07
USD	175,000	MURPHY OIL CORP 3.7% 01/12/22	136,781	169,258	0.06
USD	144,000	SABINE PASS LIQ 5.625% 01/02/21	142,020	154,456	0.06
USD	130,000	HP ENTERPRISE CO 4.9% 15/10/25 144A	130,351	133,508	0.05
USD	100,000	SOUTHWESTERN ENERGY 4.95% 23/01/25	100,781	102,250	0.04
USD	50,000	SOUTHWESTERN ENERGY 4.05% 23/01/20	50,813	51,641	0.02
USD	25,000	RITE AID CORP 6.875% 15/12/28	27,313	29,500	0.01
USD	25,000	CRESTWOOD MID 6.25% 01/04/23 WI	25,000	25,500	0.01
USD	50,000	JACK COOPER HLDG 9.25% 01/06/20	47,250	21,625	0.01
USD	25,000	BONANZA CREEK 6.75% 15/04/21	9,594	18,625	0.01
			1,348,612	1,435,684	0.53
普通社債(固定金利債)					
USD	600,000	DAIMLERCHRYSLER NA 8.5% 18/01/31	914,421	901,523	0.33
USD	834,000	CENTURLINK INC 7.65% 15/03/42	826,420	719,324	0.26
USD	625,000	KENNEDY WILSON 5.875% 01/04/24	624,999	636,718	0.23
USD	590,000	BOYD GAMING CORP 6.875% 15/05/23	595,379	634,249	0.23
USD	700,000	ANHEUSER-BUSCH INBEV 3.75% 15/07/42	668,037	627,807	0.22
USD	600,000	VERIZON COMM 4.15% 15/03/24	622,757	626,020	0.22
USD	632,000	AMGEN INC 4.563% 15/06/48 REGS	609,113	609,435	0.22
USD	600,000	APPLE INC 2.4% 03/05/23	575,674	583,225	0.21
EUR	500,000	GOLDMAM SACHS GP 2.5% 18/10/21 EMTN	676,051	573,024	0.20
USD	600,000	BMC SOFTWARE 8.125% 15/07/21 144A	590,430	560,624	0.20
USD	563,000	SCIENTIFIC GAMES INTL 10% 01/12/22	515,102	560,184	0.20
USD	506,000	SPRINT NEXTEL 9% 15/11/18 144A	573,223	557,864	0.20
USD	550,000	MICRON TECHNO 5.25% 01/08/23 144A	548,999	552,062	0.20
USD	530,000	ADVANCED MICRO 7% 01/07/24	521,828	549,874	0.19
USD	519,000	UNIVISION COMM 6.75% 15/09/22 144A	542,714	544,949	0.19

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	477,000	HCA INC 7.5% 15/02/22	552,370	540,798	0.19
USD	510,000	SPRINGLEAF FIN CORP 5.25% 15/12/19	509,999	513,824	0.18
USD	500,000	MORGAN STANLEY 3.75% 25/02/23	505,516	512,865	0.18
USD	500,000	METLIFE INC 3.6% 10/04/24	507,166	512,454	0.18
USD	499,000	GRIFFON CORP 5.25% 01/03/22	486,220	505,611	0.18
USD	475,000	GOLDMAN SACHS GP 5.15% 22/05/45	489,669	498,120	0.18
USD	500,000	ANHEUSER-BUSH INBEV 2.5% 15/07/22	480,999	491,572	0.17
USD	565,000	AVAYA INC 7% 01/04/19 144A	550,237	490,137	0.17
EUR	400,000	JPMORGAN CHASE CO 2.875% 24/5/28 EM	529,250	488,052	0.17
USD	500,000	SUMMIT MID HDGS 5.5% 15/08/22	504,999	487,499	0.17
USD	400,000	HUGHES SATELITE 7.625% 15/06/21	439,127	438,999	0.16
USD	405,000	CITGO HOLDING 10.75% 15/02/20 144A	392,343	434,362	0.16
USD	400,000	T-MOBILE USA INC 6% 01/03/23	401,489	422,499	0.15
USD	368,000	BUILDERS FIRSTS 10.75% 15/8/23 144A	366,445	422,279	0.15
USD	400,000	LYNX II CORP 6.375% 15/04/23 144A	425,499	415,499	0.15
USD	400,000	VOLKSWAGEN GRP 2.45% 20/11/19 REGS	399,103	398,914	0.15
USD	375,000	MIDAS INT HOLD 7.875% 01/10/22 144A	370,562	387,187	0.14
USD	346,000	SPRINT CAPITAL 8.75% 15/03/32	335,011	381,464	0.14
USD	330,000	MGM RESORTS INTL 6.625% 15/12/21	355,684	368,774	0.14
USD	350,000	TENET HEALTHCARE 6% 01/10/20	380,064	366,624	0.14
USD	350,000	CCO HDGS LLC/CAP 5.75% 01/09/23	351,749	365,749	0.14
USD	365,000	CLEAR CHAN WLD 7.625% 15/3/20 WI-B	379,494	364,769	0.14
USD	347,000	UNITED CONTINENTAL 6.375% 01/06/18	367,874	362,614	0.13
USD	350,000	ALLY FINANCIAL INC 5.125% 30/09/24	344,126	356,124	0.13
USD	338,000	INFOR US INC 6.5% 15/05/22 WI	340,885	352,787	0.13
USD	339,000	DISH DBS CORP 5.875% 15/11/24	339,008	348,830	0.13
USD	334,000	VIKING CRUISES 8.5% 15/10/22 144A	365,458	346,524	0.13
USD	350,000	CONSOL ENERGY 5.875% 15/04/22	354,375	344,924	0.13
USD	350,000	UNIT CORP 6.625% 15/05/21	341,250	339,499	0.13
USD	399,000	CHS COMMUNITY 8% 15/11/19	429,960	332,366	0.12
USD	314,000	KB HOME 7.625% 15/05/23	317,632	328,914	0.12
USD	300,000	HCA INC 5.875% 15/03/22	324,750	323,249	0.12
USD	300,000	NCR CORP 6.375% 15/12/23	313,250	322,499	0.12
USD	325,000	GROUP 1 AUTO 5% 01/06/22	321,673	320,937	0.12
USD	313,000	SUNOCO LP/FIN 6.25% 15/04/21 WI	313,780	318,868	0.12
USD	447,000	CHS/COMM HEALTH 6.875% 01/02/22 WI	438,702	310,664	0.12
USD	311,000	NRG ENERGY INC 7.25% 15/05/26 144A	308,139	309,444	0.12
USD	295,000	ONEMAIN FIN 7.25% 15/12/21 144A	301,777	307,537	0.11
USD	306,000	REVLON CONSUMER 5.75% 15/02/21	307,552	306,764	0.11
USD	302,000	CLEAR CHAN WLD 6.5% 15/11/22 WI	318,048	301,999	0.11
USD	296,000	UNITED RENTALS 5.5% 15/07/25	278,517	301,919	0.11
USD	325,000	DYNEGY INC 7.625% 01/11/24 WI	312,644	299,812	0.11
USD	300,000	LMI AEROSPACE INC 7.375% 15/07/19	301,500	299,249	0.11
USD	283,000	CABLEVISION SYSTEMS 7.75% 15/04/18	314,728	298,564	0.11
USD	285,000	LEVI STRAUSS&CO 6.875% 01/05/22	310,333	298,537	0.11
USD	282,000	US AIRWAYS GROUP 6.125% 01/06/18	292,850	293,632	0.11
USD	305,000	ASHTON WOODS USA 6.875% 15/2/21 144	296,273	293,562	0.11
USD	297,000	FERRELLGAS LP 6.75% 15/06/23	294,090	291,802	0.11
USD	300,000	ALLIANCE DATA SYST 5.375% 1/08/22 1	292,188	288,749	0.11
USD	275,000	ZAYO GROUP LLC/CAP 6% 01/04/23	276,677	285,999	0.11
USD	275,000	COTT BEVERAGES 6.75% 01/01/20	275,000	284,968	0.11
USD	271,000	T-MOBILE USA INC 6.731% 28/04/22	282,350	283,534	0.11
USD	275,000	CRESTWOOD MIDSTREAM 6% 15/12/20	282,219	281,875	0.10
USD	269,000	CARRIZO OIL&GAS INC 7.5% 15/09/20	276,385	278,415	0.10
USD	289,000	NAVIENT CORP 5.875% 25/10/24	282,537	274,550	0.10
USD	310,000	HEXION US FIN 6.625% 15/04/20 WI	309,438	274,350	0.10
USD	290,000	K HOVNIANIAN ENT 7.25% 15/10/20 144A	307,103	273,412	0.10
USD	259,000	FRONTIER COMM 10.5% 15/09/22	262,083	273,245	0.10
USD	350,000	HEXION US FINANCE 9% 15/11/20	339,924	273,000	0.10
USD	264,000	SUNOCO LP/FIN 5.5% 01/08/20 WI	264,000	269,280	0.10

通貨	数量/ 額面価格 ⁽¹⁾	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率(%)
USD	275,000	SONIC AUTO INC 5% 15/05/23	268,039	267,438	0.10
USD	275,000	SLM CORP 6.125% 25/03/24 MTN	281,375	267,094	0.10
USD	265,000	SUNOCO LP/FIN 6.375% 01/04/23 WI	265,000	266,988	0.10
USD	250,000	COMMSCOPE TECH FIN 6% 15/06/25 144A	250,063	265,000	0.10
USD	266,000	DISH DBS CORP 5% 15/03/23	253,911	264,670	0.10
USD	250,000	HOCKEY MERG 7.875% 01/10/21 144A	260,000	264,103	0.10
USD	245,000	SPRINT CORP 7.875% 15/09/23	262,536	261,538	0.10
USD	250,000	LEVEL 3 FIN INC 6.125% 15/1/21	263,750	259,375	0.10
USD	239,000	DIEBOLD INC 8.5% 15/04/24 WI	238,753	253,340	0.09
USD	250,000	ALLY FINANCIAL INC 3.5% 27/01/19	252,500	251,250	0.09
USD	287,000	DJO FINCO LTD 8.125% 15/06/21 144A	277,261	248,973	0.09
USD	280,000	ORTHO-CLINICAL 6.625% 15/05/22 144A	263,306	248,500	0.09
USD	228,000	SPRINGLEAF FINANCE 7.75% 1/10/21 WI	217,574	240,540	0.09
USD	315,000	CHS COMMUNITY 7.125% 15/07/20	329,938	239,495	0.09
USD	231,000	PLY GEM INDS 6.5% 01/02/22	225,633	237,064	0.09
USD	200,000	NEPTUNE FINCO 10.875% 15/10/25 144A	200,000	237,000	0.09
USD	275,000	VPI ESCROW CORP 6.375% 15/10/20 144	286,688	236,242	0.09
USD	225,000	LTF MERGER 8.5% 15/06/23 144A	224,354	232,875	0.09
USD	226,000	CERIDIAN CORP 11% 15/03/21 144A	224,538	232,215	0.09
USD	225,000	CEQUEL COM HLD 6.375% 15/09/20 144A	235,708	231,750	0.09
USD	270,000	FRONTIER COMM 9% 15/08/31	216,695	230,175	0.09
USD	222,000	WINDSTREAM CORP 7.75% 01/10/21	226,383	228,216	0.08
USD	217,000	RITE AID CORP 6.75% 15/06/21 WI	226,196	227,738	0.08
USD	225,000	PRISO ACQ CORP 9% 15/05/23 144A	225,000	225,000	0.08
USD	215,000	AMERICAN AIRLINES 4.625% 1/3/20 144	215,000	217,688	0.08
USD	250,000	CENTURYTEL INC 7.6% 15/09/39 P	244,063	215,625	0.08
USD	174,000	SPRINT NEXTEL CORP 11.5% 15/11/21	150,510	213,585	0.08
USD	214,000	KRONOS ACQUISITION 9% 15/08/23 144A	203,901	213,465	0.08
USD	200,000	DIAMOND 1 FIN/2 5.875% 15/06/21 144	206,938	212,723	0.08
USD	200,000	CIT GROUP INC 5.5% 15/02/19 144A	213,698	211,000	0.08
USD	200,000	ASHTREAD CAPITAL 5.625% 1/10/24 144	204,500	209,500	0.08
USD	205,000	FREEPORT MCMORAN 6.75% 1/2/22 144A	193,550	209,100	0.08
USD	200,000	AMERICAN EQU INV 6.625% 15/07/21	213,500	208,500	0.08
USD	205,000	L BRANDS 6.75% 01/07/36	205,156	207,563	0.08
USD	190,000	CHESAPEAKE ENERGY 8% 15/12/22 WI	143,596	205,295	0.08
USD	217,000	NRG ENERGY 6.625% 15/01/27 144A	217,125	205,065	0.08
USD	200,000	ACCESS MIDST PART 4.875% 15/05/23	206,375	203,519	0.08
USD	200,000	WEYERHAEUSER REAL 4.375% 15/6/19	190,750	203,500	0.08
USD	200,000	BEAZER HOMES USA 7.25% 01/02/23	191,400	203,000	0.08
USD	465,000	AVAYA INC 10.5% 01/03/21 144A	420,825	199,950	0.07
USD	190,000	SONIC AUTOMOTIVE 7% 15/07/22	207,100	199,025	0.07
USD	200,000	JEFFERIES FIN LLC 7.5% 15/04/21 144	200,000	198,000	0.07
USD	194,000	L BRANDS 6.875% 01/11/35	197,839	197,880	0.07
USD	250,000	EP ENERGY/EVER 6.375% 15/06/23	137,125	197,500	0.07
USD	194,000	WHITING PETROLEUM 5.75% 15/03/21	176,128	193,193	0.07
USD	185,000	GENESIS ENERGY LP 6.75% 01/08/22	182,807	192,215	0.07
USD	186,000	AMERICAN AIRLINES 5.5% 1/10/19 144A	186,365	192,045	0.07
USD	184,000	WISE METALS GRP 8.75% 15/12/18 144A	171,118	191,360	0.07
USD	186,000	SM ENERGY CO 6.125% 15/11/22	144,548	188,325	0.07
USD	180,000	CALPINE CORP 6% 15/01/22 144A	189,300	188,100	0.07
USD	175,000	T-MOBILE USA INC 6.5% 15/01/24	178,668	187,688	0.07
USD	175,000	RICE ENERGY 7.25% 01/05/23	175,273	185,500	0.07
USD	195,000	COMPRESSCO PART 7.25% 15/08/22	180,000	184,275	0.07
USD	175,000	RSI HOME PROD INC 6.5% 15/3/23 144A	175,563	182,875	0.07
USD	182,000	NUSTAR LOGISTICS 4.8% 01/09/20	150,605	182,455	0.07
USD	175,000	JBS USA LLC 7.25% 01/06/21 144A	184,094	181,127	0.07
USD	177,000	PDC ENERGY INC 6.125% 15/09/24 144A	179,025	180,983	0.07
USD	175,000	HCA INC 5.875% 15/02/26	175,978	180,250	0.07
USD	161,000	WPX ENERGY INC 8.25% 01/08/23	161,650	179,918	0.07
USD	175,000	BUILD MAT CORP 5.375% 15/11/24 144A	175,000	179,813	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	175,000	IPAYMENT INC 9.5% 15/12/19 144A	158,688	179,375	0.07
USD	165,000	INTL LEASE FIN CORP 6.25% 15/05/19	180,394	177,375	0.07
USD	170,000	ALBERTSONS LLC 6.625% 15/06/24 144A	175,790	177,225	0.07
USD	175,000	CONTINENTAL RESOURCES 5% 15/09/22	166,000	176,643	0.07
USD	200,000	ENDO FIN LLC/FINCO 6% 15/07/23 144A	200,000	175,250	0.07
USD	180,000	GOLDMAN SACHS GP 2.35% 15/11/21	179,815	174,713	0.07
USD	165,000	LIFEPOINT HOSPI 5.5% 01/12/21	170,069	171,497	0.06
USD	167,000	COTT BEVERAGES 5.375% 01/07/22	159,770	169,923	0.06
USD	177,000	UNIVISION COMM 5.125% 15/02/25 144A	179,159	169,256	0.06
USD	175,000	HARLAND CLARKE 6.875% 01/03/20 144A	178,219	168,875	0.06
USD	165,000	MORGAN STANLEY 4.35% 08/09/26 MTN	168,851	168,749	0.06
USD	175,000	ITALICS MERGER 7.125% 15/07/23 144A	175,000	167,125	0.06
USD	167,000	GOODYEAR TIRE&RUBBER 5% 31/05/26	168,094	166,238	0.06
USD	156,000	NUSTAR LOGISTICS 7.65% 15/04/18	176,800	165,945	0.06
USD	160,000	DIAMOND 1/2 FIN 4.42% 15/06/21 144A	167,605	165,411	0.06
USD	153,000	COMM SALES&LEAS 8.25% 15/10/23	153,913	162,180	0.06
USD	195,000	FREEPORT-MCMORAN 5.45% 15/03/43	99,450	161,366	0.06
USD	150,000	HCA HLDG 6.25% 15/02/21	159,938	161,250	0.06
USD	156,000	TEMPUR SEALY INTL 5.625% 15/10/23	158,041	161,070	0.06
USD	155,000	REGAL ENTERTAINMENT 5.75% 15/06/23	150,915	158,246	0.06
USD	150,000	CHARTER COMM 4.908% 23/07/25	150,953	157,823	0.06
USD	146,000	SABINE PASS LIQ 5.875% 30/6/26 144A	146,169	157,315	0.06
USD	174,000	ENLINK MIDSTREAM 5.05% 01/04/45	108,009	157,313	0.06
USD	147,000	TESORO LOGISTICS 6.375% 01/05/24	149,558	157,290	0.06
USD	150,000	AMKOR TECHNO INC 6.375% 01/10/22	158,250	156,563	0.06
USD	153,000	FELCOR LODGING LP 5.625% 01/03/23	155,797	156,060	0.06
USD	150,000	BEAZER HOMES USA 5.75% 15/06/19	145,500	155,250	0.06
USD	150,000	CHESAPEAKE ENERGY 6.5% 15/08/17	139,083	154,500	0.06
USD	165,000	TRIUMPH GROUP 5.25% 01/06/22	159,806	153,863	0.06
USD	150,000	HARLAND CLARKE 9.75% 01/08/18 144A	160,688	153,375	0.06
USD	133,000	ONEOK INC 7.5% 01/09/23	131,177	152,950	0.06
USD	129,000	WESTERN DIGITAL 10.5% 01/04/24 144A	129,153	152,543	0.06
USD	150,000	NATIONSTAR MORT/CAP 6.5% 01/08/18	150,000	152,438	0.06
USD	150,000	TRANSOCEAN INC 6% 15/03/18	151,250	151,875	0.06
USD	185,000	WEATHERFORD INTL 6.8% 15/06/37	138,373	151,700	0.06
USD	143,000	CORTES NP ACQ 9.25% 15/10/24 144A	143,225	151,580	0.06
USD	140,000	MGM RESORTS INTL 6% 15/03/23	141,198	151,200	0.06
USD	160,000	ROWAN COMPANIES 4.875% 01/06/22	113,800	151,200	0.06
USD	144,000	BALL CORP 5.25% 01/07/25	144,000	150,480	0.06
USD	150,000	NEW ENTERPRISE 11% 01/09/18	144,094	149,625	0.06
USD	133,000	POST HLDGS 8% 15/07/25 144A	147,218	148,960	0.06
USD	150,000	ICAHN ENTS FIN 5.875% 01/02/22	144,614	148,875	0.06
USD	148,000	TEMPUR SEALY INTL 5.5% 15/6/26	148,248	148,740	0.06
USD	150,000	CALPINE CORP 5.375% 15/01/23	149,350	146,625	0.05
USD	138,000	PROJECT HOMESTAKE 8.875% 1/3/23 144	139,748	146,624	0.05
USD	132,000	DISH DBS CORP 7.875% 01/09/19	149,393	146,520	0.05
USD	155,000	DYNEGY INC 8% 15/01/25 144A	151,613	145,313	0.05
USD	141,000	BELDEN INC 5.5% 01/09/22 144A	144,525	145,230	0.05
USD	148,000	MENS WEARHOUSE 7% 01/07/22	146,280	145,040	0.05
USD	140,000	CCO HDGS LLC 5.75% 15/02/26 144A	140,000	144,900	0.05
USD	135,000	HP INC 4.65% 09/12/21	147,335	143,965	0.05
USD	154,000	AVIS BUDGET CAR 5.25% 15/03/25 144A	140,910	143,605	0.05
USD	140,000	BEAZER HOMES USA 7.5% 15/09/21	137,373	143,500	0.05
USD	150,000	TOWNSQUARE MEDIA 6.5% 01/04/23 144A	150,429	143,250	0.05
USD	155,000	VIACOM INC 3.45% 04/10/26	154,227	143,165	0.05
USD	175,000	IHEART COMMUNICATIONS 9% 15/12/19	145,297	143,063	0.05
USD	150,000	AT&T 4.75% 15/05/46	136,822	142,287	0.05
USD	132,000	BOYD GAMING CORP 6.375% 1/4/26 1	133,164	142,164	0.05
USD	136,000	OWENS-BROCKWAY 5.875% 15/08/23 144A	134,339	141,780	0.05
USD	150,000	RR DONNELLEY 6% 01/04/24	145,875	141,375	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	138,000	REYNOLDS GRP ISS 5.125% 15/7/23 144	138,875	140,933	0.05
USD	135,000	LEVEL 3 FIN INC 5.375% 15/08/22 WI	134,156	139,388	0.05
USD	277,000	CLAIRE'S ST 9% 15/03/19 144a	283,075	138,500	0.05
USD	121,000	ALLY FINANCIAL INC 8% 15/03/20	143,990	137,033	0.05
USD	128,000	FIRST DATA CORP 7% 01/12/23 144A	130,438	136,800	0.05
USD	135,000	ANHEUSER BUSCH IN 3.65% 01/02/26	136,365	136,787	0.05
USD	133,000	US AIRWAY 12-2C PTT 5.45% 03/06/18	134,663	136,658	0.05
USD	125,000	NATHAN'S FAMOUS 10% 15/03/20 144A	129,000	135,938	0.05
USD	134,000	HEALTHSOUTH CORP 5.75% 01/11/24	131,678	135,675	0.05
USD	130,000	CONCHO RESOURCES 5.5% 01/04/23	127,075	134,719	0.05
USD	143,000	EVOLUTION ESC 7.5% 15/03/22 144A	143,000	132,990	0.05
USD	130,000	CITIGROUP INC 4.4% 10/06/25	136,198	132,758	0.05
USD	115,000	CHARTER COMM 6.484% 23/10/45 WI	115,000	132,595	0.05
USD	125,000	INCEPTION MRGR 8.625% 15/11/24 144A	125,599	132,306	0.05
USD	125,000	RADIAN GROUP INC 5.25% 15/06/20	125,000	130,625	0.05
USD	158,000	GENWORTH HDGS INC 4.9% 15/08/23	129,031	130,350	0.05
USD	135,000	SM ENERGY CO 5.625% 01/06/25	135,000	130,275	0.05
USD	135,000	GENERAL MOTORS FIN 4% 06/10/26	134,812	129,550	0.05
USD	130,000	HEXION INC 10% 15/04/20	127,125	129,350	0.05
USD	125,000	CENTURYLINK INC 6.75% 01/12/23 W	125,563	127,813	0.05
USD	121,000	EQUINIX INC 5.875% 15/01/26	121,429	127,340	0.05
USD	117,000	SPRINGLEAF FIN 8.25% 15/12/20	117,000	127,238	0.05
USD	132,000	WINDSTREAM CORP 7.50% 01/04/23	122,434	127,050	0.05
USD	150,000	TPC GROUP INC 8.75% 15/12/20 144A	117,563	126,750	0.05
USD	132,000	CLEAR CHANNEL WORL 7.625% 15/3/20 A	137,610	126,720	0.05
USD	125,000	WILLIAM LYON HOM 5.75% 15/04/19	125,625	126,250	0.05
USD	150,000	JC PENNEY CORP INC 6.375% 15/10/36	132,563	126,188	0.05
USD	125,000	CBL&ASSOCIATES LP 5.95% 15/12/26	123,206	125,586	0.05
USD	125,000	ALLY FINANCIAL INC 3.25% 05/11/18	124,823	125,156	0.05
USD	116,000	SABINE PASS LIQ 5.625% 1/03/25	114,189	124,555	0.05
USD	119,000	DAVITA INC 5.75% 15/08/22	126,803	124,355	0.05
USD	119,000	NRG ENERGY INC 7.875% 15/05/21	129,582	124,058	0.05
USD	117,000	HOLOGIC INC 5.25% 15/07/22 144A	118,647	123,289	0.05
USD	130,000	TENET HEALTHCARE 8.125% 1/4/22	129,495	122,655	0.05
USD	137,000	FRONTIER COMM 7.625% 15/04/24	145,952	122,615	0.05
USD	118,000	FIRST DATA CORP 5.75% 15/01/24 144A	117,986	121,762	0.05
USD	115,000	CITGO PETROLEUM 6.25% 15/08/22 144A	121,025	120,175	0.04
USD	118,000	GULFPORT ENERGY 6.375% 15/5/25 144A	118,000	119,499	0.04
USD	116,000	CALLON PETRO 6.125% 01/10/24 144A	116,894	119,480	0.04
USD	125,000	DYNEGY INC 7.375% 01/11/22 WI	119,783	119,375	0.04
USD	114,000	ALTA MESA HDGS 7.875% 15/12/24 144A	115,363	117,990	0.04
USD	125,000	MICROSOFT CORP 3.95% 08/08/56	121,881	117,628	0.04
USD	150,000	MURRAY ENERGY 11.25% 15/04/21 144A	105,000	116,250	0.04
USD	112,000	LIVE NATION ENT 5.375% 15/06/22 144	113,400	115,920	0.04
USD	115,000	BK OF AMERICA CORP 3.95% 21/4/25 L	118,565	114,276	0.04
USD	105,000	ENTERTAINMENT PROP 5.75% 15/08/22	116,241	112,937	0.04
USD	100,000	DISH DBS CORP 7.75% 01/07/26	102,460	112,750	0.04
USD	114,000	CALPINE CORP 5.25% 01/06/26 144A	114,000	112,290	0.04
USD	116,000	CALPINE CORP 5.75% 15/01/25	118,018	111,940	0.04
USD	148,000	IHEART COM 10.625% 15/03/23	147,108	111,740	0.04
USD	112,000	XERIUM TECHNO 9.5% 15/08/21 144A	110,365	111,720	0.04
USD	102,000	CABLEVISION SYSTEMS 8% 15/04/20	114,832	111,690	0.04
USD	125,000	KINDRED HEALTH 6.375% 15/04/22	126,128	111,563	0.04
USD	100,000	ENERGY TRANSFER EQ 7.5% 15/10/20	94,375	111,500	0.04
USD	100,000	POST HLDGS 7.75% 15/03/24 144A	100,000	111,000	0.04
USD	100,000	DIAMOND 1/2 FIN 7.125% 15/06/24 144	101,903	110,955	0.04
USD	108,000	ANTERO RESOURCE FIN 5.375% 01/11/21	99,137	110,430	0.04
USD	100,000	WESTERN DIGITAL 7.375% 01/04/23 144	100,431	110,000	0.04
USD	112,000	CBL & ASSOCIATES LP 5.25% 01/12/23	106,281	109,966	0.04
USD	109,000	BUILDERS FIRSTS 5.625% 1/09/24 144A	109,348	109,545	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	103,000	NAVIENT CORP 6.625% 26/07/21	103,000	108,923	0.04
USD	100,000	CHENIERE CORP CHRIS 7% 30/6/24 144A	100,000	108,812	0.04
USD	135,000	K HOVNANIAN ENT 9.125% 15/11/20 144	126,263	108,338	0.04
USD	135,000	VIACOM INC 4.375% 15/03/43	106,691	107,251	0.04
USD	100,000	POST HLDGS 6.75% 01/12/21 144A	102,875	106,750	0.04
USD	99,000	DOLLAR TREE INC 5.75% 01/03/23	99,715	104,823	0.04
USD	104,000	HUGHES SATELITE 6.625% 01/08/26 144	103,325	104,520	0.04
USD	100,000	EMDEON INC 6% 15/02/21 144A	100,000	104,500	0.04
USD	100,000	HUNT COS INC 9.625% 01/03/21 144A	102,750	104,375	0.04
USD	100,000	DANA HOLDING CO 6% 15/09/23	105,583	104,375	0.04
USD	100,000	SPRINGLEAF FIN CORP 6.9% 15/12/17 M	106,125	104,280	0.04
USD	100,000	HRG GROUP 7.75% 15/01/22	98,883	104,250	0.04
USD	100,000	TRANSDIGM INC 6% 15/07/22	99,250	104,000	0.04
USD	100,000	JDA ESC / BOND 7.375% 15/10/24 144	101,750	103,750	0.04
USD	100,000	NEXSTAR BROAD 6.125% 15/02/22 144A	100,482	103,500	0.04
USD	96,000	RITE AID CORP 6.125% 01/04/23 144A	96,000	103,200	0.04
USD	100,000	WELLCARE HEALTH 5.75% 15/11/20	104,500	103,000	0.04
USD	100,000	WINDSTREAM CORP 7.75% 15/10/20	98,438	102,800	0.04
USD	100,000	FREEPORT MCMORAN 6.5% 15/11/20 144A	74,636	102,750	0.04
USD	100,000	LEVEL 3 COMM 5.75% 01/12/22 WI	100,107	102,750	0.04
USD	250,000	LINN ENERGY LLC 8.625% 15/4/20	159,515	102,500	0.04
USD	103,000	HEALTHSOUTH CORP 5.75% 15/09/25	103,000	102,485	0.04
USD	100,000	RIVERS PITTS/FIN 6.125% 15/08/21 14	102,380	102,250	0.04
USD	100,000	CNH CAPITAL L 3.875% 16/07/18	99,642	101,625	0.04
USD	98,000	FRONTIER COMM 11% 15/09/25	100,138	101,185	0.04
USD	100,000	SPRINT NEXTEL CORP 9.125% 1/03/17 W	103,375	101,125	0.04
USD	100,000	OWENS-BROCKWAY 5.375% 15/01/25 144A	101,000	100,750	0.04
USD	100,000	LAREDO PETROLEUM 5.625% 15/01/22	81,000	100,750	0.04
USD	97,000	FIRST DATA CORP 6.75% 01/11/20 144A	102,456	100,638	0.04
USD	100,000	CATERPILLAR FIN 2.25% 01/12/19 MTN	99,920	100,385	0.04
USD	95,000	OWENS-BROCKWAY 6.375% 15/08/25 144A	95,000	100,225	0.04
USD	113,000	TENET HEALTHCARE 6.75% 15/06/23	112,159	99,723	0.04
USD	100,000	HESS CORP 4.3% 01/04/27	99,790	99,344	0.04
USD	95,000	POST HLDGS 7.375% 15/02/22	100,225	99,038	0.04
USD	97,000	TARGA RESOURCES 5% 15/01/18	97,000	98,698	0.04
USD	100,000	ROSE ROCK MIND 5.625% 15/11/23 WI	97,265	97,500	0.04
USD	97,000	DAVITA HEALTHCARE 5.125% 15/07/24	95,909	96,788	0.04
USD	100,000	REALOGY GROUP 4.875% 01/06/23 144A	99,269	96,500	0.04
USD	97,000	BOISE CASCADE CO 5.625% 1/9/24 144A	97,000	96,273	0.04
USD	78,000	DIAMOND 1/2 FIN 8.35% 15/07/46 144A	77,938	95,812	0.04
USD	95,000	ALLY FINANCIAL INC 5.75% 20/11/25	94,001	94,763	0.04
USD	88,000	ENSEMBLE S MERGER 9% 30/09/23 144A	86,498	93,280	0.03
USD	100,000	CLOUD PEAK ENERGY 8.50% 15/12/19	76,000	92,500	0.03
USD	95,000	IRON MOUNTAIN US 5.375% 01/06/26 14	95,000	91,913	0.03
USD	100,000	ERAC USA FIN 4.2% 01/11/46 144A	99,238	91,104	0.03
USD	97,000	VERIZON COMMUN 4.672% 15/03/55	90,851	91,094	0.03
USD	91,000	PILGRIM'S PRI 5.75% 15/03/25 144A	91,000	90,773	0.03
USD	84,000	TARGA RESOURCES 6.75% 15/03/24	84,000	90,090	0.03
USD	90,000	GENERAL MOTORS 3.2% 06/07/21	89,835	89,168	0.03
USD	90,000	ALBERTSONS 5.75% 15/03/25 144A	90,000	89,100	0.03
USD	87,000	CHENIERE CORP 5.875% 31/03/25 144A	87,000	88,767	0.03
USD	82,000	BEAZER HOMES USA 8.75% 15/03/22 144	82,000	88,560	0.03
USD	83,000	REYNOLDS GRP ISS 7% 15/07/24 144A	83,000	88,239	0.03
USD	90,000	MERITOR INC 6.25% 15/02/24	90,648	88,200	0.03
USD	85,000	AIR LEASE CORP 3.875% 01/04/21	89,474	87,330	0.03
USD	86,000	FIRST DATA CORP 5% 15/01/24 144A	86,000	86,458	0.03
USD	85,000	FORD MOTOR CO 5.291% 08/12/46	85,000	86,255	0.03
USD	81,000	UNITED RENTALS 7.625% 15/04/22	90,227	85,253	0.03
USD	81,000	FREEPORT MCMORAN 6.875% 15/2/23 144	68,850	85,253	0.03
USD	83,000	UNIVERSAL HEALTH 4.75% 01/08/22 144	83,596	84,370	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	85,000	GENERAL MOTORS FIN CO 4.3% 13/07/25	80,932	84,172	0.03
USD	100,000	ANNA MERGER SUB 7.75% 01/10/22 144A	101,917	84,000	0.03
USD	80,000	KINDER MORGAN INC 5.55% 01/06/45	79,121	83,912	0.03
USD	75,000	MGM RESORTS INTL 6.75% 01/10/20	81,188	83,438	0.03
USD	70,000	GENERAL MOTORS CO 6.75% 01/04/46	72,188	81,874	0.03
USD	75,000	PRIME SECSRVC 9.25% 15/05/23 144A	78,038	81,656	0.03
USD	75,000	GREYSTAR REAL 8.25% 01/12/22 144A	75,563	81,188	0.03
USD	80,000	FORD MOTOR CO 4.346% 08/12/26	80,000	80,683	0.03
USD	120,000	RESOLUTION FDG STRIP 0% 15/04/29	87,780	80,633	0.03
USD	75,000	ECO SERVICES 8.5% 01/11/22 144A	75,000	79,688	0.03
USD	75,000	RCN TELE SER CAP 8.5% 15/08/20 144A	79,063	79,500	0.03
USD	75,000	PATRIOT MERGER CORP 9% 15/07/21 144	74,625	79,125	0.03
USD	75,000	MATCH GRP 6.375% 01/06/24	75,531	79,125	0.03
USD	75,000	FBM FINANCE INC 8.25% 15/08/21 144A	75,000	79,125	0.03
USD	75,000	SPECTRUM BRANDS 6.125% 15/12/24	75,000	79,125	0.03
USD	75,000	INVENTIV HEALTH 7.5% 01/10/24 144A	75,000	78,555	0.03
USD	75,000	MPT OPER PARTNER 6.375% 01/03/24	75,000	78,469	0.03
USD	75,000	CALPINE CORP 5.875% 15/01/24 144A	80,250	78,188	0.03
USD	75,000	HALCON RES CORP 8.625% 01/02/20 144	74,063	78,000	0.03
USD	75,000	FELCOR LODGING LP 6% 01/06/25	75,000	78,000	0.03
USD	75,000	CHURCHILL DOWNS 5.375% 15/12/21	75,750	77,813	0.03
USD	75,000	SPRINT NEXTEL 8.375% 15/08/17	78,225	77,813	0.03
USD	79,000	AVIS BUDGET CAR 5.5% 01/04/23	76,567	77,618	0.03
USD	75,000	COGENT COM 5.375% 01/03/22 144A	75,000	77,438	0.03
USD	75,000	LUCENT TECHNOLOGIES 6.5% 15/01/28	76,688	77,438	0.03
USD	75,000	ENERGY TRANSFER EQ 5.875% 15/01/24	71,116	77,438	0.03
USD	77,000	ALLY FINANCIAL INC 3.25% 13/02/18	76,456	77,385	0.03
USD	75,000	ARAMARK SERV INC 5.125% 15/01/24 14	77,813	77,344	0.03
USD	75,000	CINEMARK USA 5.125% 15/12/22	75,188	77,250	0.03
USD	75,000	CPG MERGER SUB 8% 01/10/21 144A	79,125	77,250	0.03
USD	75,000	TRANSDIGM INC 6.375% 15/06/26 144A	75,000	77,025	0.03
USD	74,000	T-MOBILE USA 6.25% 01/04/21	77,515	76,960	0.03
USD	75,000	ICAHN ENTER 6% 01/08/20	70,800	76,594	0.03
USD	75,000	AK STEEL CORP 7.625% 15/05/20	69,164	76,500	0.03
USD	75,000	COMPASS INV/ONEX 7.75% 15/01/21 144	74,719	76,500	0.03
USD	80,000	AMGEN INC 4.4% 01/05/45	86,314	76,454	0.03
USD	80,000	ABBVIE INC 4.45% 14/05/46	79,462	76,376	0.03
USD	75,000	DONNELLEY FIN 8.25% 15/10/24 144A	75,000	76,313	0.03
USD	75,000	CEQUEL COM HLD 5.125% 15/12/21 144A	68,813	76,313	0.03
USD	74,000	AMER AIRLN 13-1 C 6.125% 15/07/18 1	77,515	76,220	0.03
USD	75,000	LOGO MERGER SUB 8.375% 15/10/20 144	75,563	76,125	0.03
USD	75,000	LANDRY'S INC 6.75% 15/10/24 144A	75,000	76,125	0.03
USD	75,000	MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25	75,000	75,938	0.03
USD	75,000	TARGA RESOURCES 4.125% 15/11/19	75,000	75,938	0.03
USD	77,000	CONTINENTAL RES 4.5% 15/04/23	69,108	75,460	0.03
USD	70,000	APPLE INC 4.65% 23/02/46	74,796	75,357	0.03
USD	75,000	LADDER CAP FIN 7.375% 01/10/17	77,625	75,000	0.03
USD	75,000	SPEEDWAY MOTORSP 5.125% 01/02/23	75,000	74,813	0.03
USD	75,000	FREEPORT-MCMORAN 2.375% 15/03/18	58,688	74,438	0.03
USD	75,000	NEXSTAR ESCROW 5.625% 01/08/24 144A	75,000	74,438	0.03
USD	75,000	MIRCON TECH INC 5.625 15/1/26 144A	69,703	74,344	0.03
USD	61,000	EL PASO CORP 7.75% 15/01/32	58,228	74,338	0.03
USD	75,000	TENET HEALTHCARE 5.5% 01/03/19	76,781	73,781	0.03
USD	75,000	CALPINE CORP 5.5% 01/02/24	75,000	72,375	0.03
USD	72,000	TARGA RESOURCES 5.125% 1/02/25 144A	72,138	71,460	0.03
USD	67,000	DIAMOND 1/2 FIN 5.45% 15/06/23 144A	66,971	71,059	0.03
USD	72,000	CNH INDUS CAP 3.875% 15/10/21	71,598	70,830	0.03
USD	125,000	APPVION INC 9% 01/06/20 144A	65,781	70,625	0.03
USD	70,000	WELLS FARGO & CO 4.75% 07/12/46 MTN	69,867	70,623	0.03
USD	69,000	NAVIENT CORP 5% 26/10/20	68,562	70,380	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	65,000	ANHEUSER BUSCH IN 4.9% 01/02/46	64,847	70,056	0.03
USD	66,000	INFOR US INC 5.75% 15/08/20 144A	65,715	69,135	0.03
USD	66,000	JBS USA LLC 5.75% 15/06/25 144A	64,250	66,825	0.02
USD	65,000	ABBOTT LABORATORIES 4.9% 30/11/46	64,494	66,514	0.02
USD	75,000	AVAYA INC 9% 01/04/19 144A	58,000	66,188	0.02
USD	78,000	FRONTIER COMM 6.875% 15/01/25	77,709	66,105	0.02
USD	64,000	TESORO LOGISTICS 5.875% 1/10/20	66,400	66,000	0.02
USD	65,000	ALLY FINANCIAL INC 5.5% 15/02/17	68,911	65,244	0.02
USD	64,000	VEREIT OPERAT PART 4.125% 01/06/21	64,280	64,960	0.02
USD	60,000	ENERGY TRANSF PARTN 6.5% 01/02/42	70,691	64,665	0.02
USD	65,000	AIR LEASE CORP 2.125% 15/01/20	64,768	64,015	0.02
USD	62,000	GULFPORT ENERGY 6% 15/10/24 144A	62,000	63,085	0.02
USD	75,000	NWH ESCROW CORP 7.5% 01/08/21 144a	70,500	63,000	0.02
USD	68,000	GENWORTH FINANCIAL 7.625% 24/09/21	69,688	62,730	0.02
USD	60,000	LIFEPOINT HEALTH 5.875% 01/12/23	60,000	60,750	0.02
USD	58,000	IRON MOUNTAIN 4.375% 01/06/21 144A	58,000	59,305	0.02
USD	55,000	T-MOBILE USA 6.625% 01/04/23	58,141	58,300	0.02
USD	50,000	GMAC 8% 01/11/31	58,500	57,875	0.02
USD	50,000	MANITOWOC FOOD 9.5% 15/02/24	50,000	57,625	0.02
USD	50,000	WILLIAMS CO INC 7.5% 15/01/31 A	51,983	56,375	0.02
USD	55,000	NOVELIS CORP 5.875% 30/09/26 144A	55,000	55,550	0.02
USD	57,000	ENLINK MILDSTREAM PRTN 4.15% 1/6/25	46,313	55,229	0.02
USD	50,000	KINDER MORGAN ENE 6.5% 01/09/39	57,736	55,115	0.02
USD	50,000	CLIFFS NATURAL RES 8.25% 31/3/20 14	52,500	54,750	0.02
USD	54,000	SPRINGLEAF FINANCE 6% 01/06/20 WI	53,460	54,743	0.02
USD	54,000	PARSLEY ENERGY 5.375% 15/01/25 144A	54,000	54,184	0.02
USD	50,000	MERITAGE HOMES CORP 7% 01/04/22	52,250	54,125	0.02
USD	50,000	WESTERN REFINING 7.5% 15/02/23	42,000	54,000	0.02
USD	50,000	ALERIS INTL INC 9.5% 01/04/21 144A	51,250	53,625	0.02
USD	50,000	CONTURA ENERGY INC 10% 01/08/21 144	52,750	53,375	0.02
USD	50,000	BEACON ROOF 6.375% 01/10/23	50,000	53,344	0.02
USD	55,000	VIACOM INC 3.875% 01/04/24	52,998	53,293	0.02
USD	50,000	MIDCONTINENT COM 6.875% 15/08/23 14	50,917	53,250	0.02
USD	50,000	GOLDEN NUGGET ESC 8.5% 01/12/21 144	50,063	53,125	0.02
USD	75,000	GENON ENERGY INC 9.5% 15/10/18	78,150	53,016	0.02
USD	50,000	ELDORADO RES INC 7% 01/08/23 WI	50,000	53,000	0.02
USD	50,000	SPRINT CAP CORP 6.9% 01/05/19	51,125	52,938	0.02
USD	52,000	DYNEGY INC 6.75% 01/11/19	53,690	52,910	0.02
USD	50,000	US CONCRETE INC 6.375% 01/06/24	50,000	52,875	0.02
USD	50,000	TENET HEALTHCARE 6.25% 01/11/18	52,188	52,813	0.02
USD	50,000	CENTRAL GARDEN PET 6.125% 15/11/23	50,000	52,750	0.02
USD	50,000	GOODYEAR TIRE&RUBBER 7% 15/05/22	52,808	52,750	0.02
USD	50,000	NEWFIELD EXPLOR CO 5.75% 30/01/22	45,750	52,688	0.02
USD	50,000	HERC RENTALS INC 7.5% 01/06/22 144A	51,500	52,688	0.02
USD	50,000	CIT GROUP INC 6.625% 01/04/18 144A	52,938	52,688	0.02
USD	50,000	DEAN FOODS 6.5% 15/03/23 144A	50,000	52,625	0.02
USD	50,000	STANDARDAERO AVIAT 10% 15/07/23 144	49,325	52,625	0.02
USD	50,000	PARSLEY ENERGY 6.25% 01/06/24 144A	50,500	52,615	0.02
USD	50,000	PRESTIGE BRANDS 6.375% 01/03/24 144	50,000	52,500	0.02
USD	50,000	CBS RADIO INC 7.25% 01/11/24 144A	50,625	52,500	0.02
USD	50,000	RANGE RESOURCES 5.75% 01/06/21 144A	41,500	52,375	0.02
USD	50,000	A SCHULMAN INC 6.875% 01/06/23 144A	50,000	52,250	0.02
USD	50,000	MULTI-COLOR 6.125% 01/12/22 144A	50,000	52,250	0.02
USD	50,000	WR GRACE & CO 5.125% 01/10/21 144A	50,000	52,125	0.02
USD	50,000	MGIC INVESTMENT CORP 5.75% 15/08/23	50,000	52,125	0.02
USD	50,000	HRG GROUP 7.875% 15/07/19	52,250	52,125	0.02
USD	50,000	RANGE RESOURCES 5.875% 1/07/22 144A	46,625	52,000	0.02
USD	50,000	CLOUD PEAK ENERGY 12% 01/11/21	50,531	52,000	0.02
USD	50,000	SALLY HDGS/CAP 5.625% 01/12/25	50,438	52,000	0.02
USD	50,000	WAVEDIVISION ESC 8.125% 1/09/20 144	53,000	52,000	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	50,000	CABLEVISION SYSTEMS 8.625% 15/09/17	52,125	52,000	0.02
USD	50,000	ALLY FINANCIAL 6.25% 01/12/17	52,250	51,875	0.02
USD	50,000	TESORO CORP 5.375% 01/10/22	51,125	51,875	0.02
USD	50,000	SS&C TECH HOLD 5.875% 15/07/23	50,000	51,813	0.02
USD	50,000	TERRAFORM POWER 6.125% 15/06/25 144	38,875	51,750	0.02
USD	50,000	WILLIAM LYON HOME 7% 15/08/22	51,000	51,750	0.02
USD	50,000	MERCER INTL 7% 01/12/19	50,000	51,625	0.02
USD	50,000	GIBRALTAR STEEL 6.25% 01/02/21	52,063	51,500	0.02
USD	50,000	NBTY INC 7.625% 15/05/21 144A	50,000	51,500	0.02
USD	50,000	SM ENERGY CO 6.75% 15/09/26	50,167	51,500	0.02
USD	50,000	ABC SUPPLY 5.75% 15/12/23 144A	50,000	51,500	0.02
USD	50,000	FRESENIUS MED 4.125% 15/10/20 144A	50,000	51,500	0.02
USD	50,000	SABRA HEALTH 5.5% 01/02/21	49,750	51,375	0.02
USD	50,000	NABORS INDUS 5% 15/09/20	49,844	51,375	0.02
USD	50,000	TRANSOCEAN INC 9% 15/07/23 144A	49,750	51,250	0.02
USD	50,000	HECLA MINING CO 6.875% 01/05/21	46,844	51,125	0.02
USD	50,000	MEDIACOM LLC/CORP 5.5% 15/04/21	50,750	51,125	0.02
USD	50,000	MOHEGAN TRIBAL 7.875% 15/10/24 144A	49,636	51,000	0.02
USD	50,000	ARUBA INV 8.75% 15/02/23 144A	50,000	51,000	0.02
USD	50,000	CONSTELL BRANDS 7.25% 15/05/17 WI	52,750	51,000	0.02
USD	50,000	FREEPORT MCMORAN 6.625% 1/5/21 144A	37,625	51,000	0.02
USD	50,000	JACK OHIO FIN 10.25% 15/11/22 144	50,000	50,875	0.02
USD	50,000	BANKRATE INC 6.125% 15/08/18 144A	49,500	50,625	0.02
USD	50,000	RHP HOTEL /RHP FIN 5% 15/04/23	50,000	50,500	0.02
USD	50,000	CHESAPEAKE ENERGY 6.625% 15/08/20	47,000	50,500	0.02
USD	50,000	SABINE PASS LIQUEF 5% 15/03/27 144A	50,688	50,438	0.02
USD	50,000	CRESCENT COMM 8.875% 15/10/21 144A	50,281	50,375	0.02
USD	50,000	TESORO CORP 4.75% 15/12/23 144A	50,000	50,250	0.02
USD	50,000	WHITING PETROLEUM 5% 15/03/19	48,063	50,196	0.02
USD	50,000	ALERIS INTL INC 7.875% 01/11/20	41,500	50,125	0.02
USD	50,000	BLUE RACER MID 6.125% 15/11/22 144A	49,988	50,063	0.02
USD	50,000	CHESAPEAKE ENERGY 6.875% 15/11/20	46,354	50,000	0.02
USD	50,000	BMC EAST LLC 5.5% 01/10/24 144A	50,000	49,875	0.02
USD	50,000	SUNCOKE ENERGY 7.375% 01/02/20 144A	51,000	49,750	0.02
USD	50,000	ALERE INC 6.375% 01/07/23 144A	50,000	49,688	0.02
USD	50,000	GRAY TELE INC 5.875% 15/07/26 144A	50,500	49,625	0.02
USD	50,000	RANGE RESOURCES 5% 15/03/23 144A	49,438	49,500	0.02
USD	50,000	LENNAR CORP 4.875% 15/12/23	49,313	49,500	0.02
USD	50,000	GROUP 1 AUTO 5.25% 15/12/23 144A	50,000	49,500	0.02
USD	50,000	EMC CORP 1.875% 01/06/18	49,406	49,442	0.02
USD	50,000	COOPER STANDARD 5.625% 15/11/26	50,000	49,438	0.02
USD	50,000	GEO GROUP INC 6% 15/04/26	50,000	49,125	0.02
USD	50,000	PBF LOGIST LP/FIN 6.875% 15/5/23 WI	50,000	49,125	0.02
USD	50,000	BLUELINE RENTAL FIN 7% 01/02/19 144	51,250	48,750	0.02
USD	50,000	CEB INC 5.625% 15/06/23 144A	50,000	48,625	0.02
USD	48,000	COMM SALES&LEAS 7.125% 15/12/24 144	48,160	48,380	0.02
USD	45,000	SCIENTIFIC GAMES INTL 7% 1/1/22 144	45,000	48,263	0.02
USD	50,000	SINCLAIR TELE 5.125% 15/02/27 144A	50,000	47,500	0.02
USD	50,000	SOUTHWESTERN ENERGY 4.1% 15/03/22	39,188	47,240	0.02
USD	46,000	MERITOR INC 6.75% 15/06/21	46,575	47,035	0.02
USD	50,000	HILLMAN GROUP INC 6.375% 15/7/22 14	42,750	47,000	0.02
USD	50,000	EMBARQ CORP 7.995% 01/06/36	52,375	46,875	0.02
USD	50,000	KINDRED HEALTH 8.75% 15/01/23	50,042	46,688	0.02
USD	46,000	UNITED RENTALS 5.5% 15/05/27	46,000	45,655	0.02
USD	50,000	INN MOUNTAIN GODS 8.75% 30/11/20 14	46,750	45,500	0.02
USD	43,000	CENTURYLINK INC 7.5% 01/04/24 Y	43,197	45,150	0.02
USD	50,000	CHAPARRAL ENERGY 7.625% 15/11/22	12,406	44,750	0.02
USD	50,000	INTREPID AVIATION 6.875% 15/2/19 14	45,875	44,750	0.02
USD	51,000	HERTZ CORP 5.5% 15/10/24 144A	51,000	44,561	0.02
USD	50,000	PEABODY ENERGY 10% 15/03/22 144A	35,675	44,469	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	42,000	KB HOME 7% 15/12/21	42,339	44,310	0.02
USD	45,000	OMEGA HEATH INV 4.5% 15/01/25	44,609	44,024	0.02
USD	50,000	CNG HLDG INC 9.375% 15/05/20 144A	37,688	43,375	0.02
USD	40,000	DENBURY RESOURCES 9% 15/05/21 144A	20,664	43,300	0.02
USD	44,000	DIAMONDBACK EN 4.75% 01/11/24 144A	44,000	43,120	0.02
USD	39,000	CENTURYLINK INC 6.45% 15/06/21	39,731	41,340	0.02
USD	40,000	KINDER MORGAN 5.5% 01/03/44	37,957	40,967	0.02
USD	50,000	VALEANT PHARMA 7.25% 15/07/22 144A	45,104	40,875	0.02
USD	50,000	NORTHERN OIL AND GAS 8% 01/06/20	47,500	40,750	0.02
USD	50,000	K HOVNANIAN ENT 8% 01/11/19 144A	50,000	40,000	0.01
USD	44,000	SEAGATE HDD CAY 4.875% 01/06/27	34,473	39,574	0.01
USD	39,000	STARWOOD PROP TST 5% 15/12/21 144A	39,000	39,523	0.01
USD	42,000	TRONOX FINANCE 6.375% 15/08/20	39,040	39,270	0.01
USD	37,000	SM ENERGY CO 6.5% 15/11/21	35,058	37,740	0.01
USD	35,000	EP ENERGY/EVER 8% 29/11/24 144A	35,000	37,615	0.01
USD	33,000	MICRON TECH INC 7.5% 15/09/23 144A	33,000	36,548	0.01
USD	50,000	RRI ENERGY INC 7.875% 15/06/17	45,875	35,625	0.01
USD	50,000	SUNGARD AVAIL 8.75% 01/04/22 144A	34,875	34,250	0.01
USD	31,000	OASIS PETROLEUM 6.5% 01/11/21	28,404	31,581	0.01
USD	25,000	RITE AID CORP 7.7% 15/02/27	28,458	31,250	0.01
USD	30,000	SLM CORP 4.875% 17/06/19 MTN	30,600	31,050	0.01
USD	40,000	PUERTO RICO CMWLTH 6% 01/07/44	29,600	30,350	0.01
USD	30,000	CONSOLIDATED EDISON 4.3% 01/12/56 C	29,739	29,851	0.01
USD	28,000	NOVELIS CORP 6.25% 15/08/24 144A	28,000	29,680	0.01
USD	33,000	WINDSTREAM CORP 6.375% 01/08/23	29,618	29,453	0.01
USD	25,000	WILLIAMS COS 7.875% 01/09/21	20,729	28,563	0.01
USD	25,000	SOLERA LLC/FIN 10.5% 01/03/24 144A	23,750	28,125	0.01
USD	25,000	MGM RESORTS INTL 8.625% 01/02/19	28,438	28,094	0.01
USD	25,000	RADIAN GROUP INC 7% 15/03/21	25,000	27,813	0.01
USD	25,000	GREIF INC 7.75% 01/08/19	28,625	27,750	0.01
USD	25,000	HCA INC 8% 01/10/18	27,906	27,250	0.01
USD	25,000	NCI BUILDING SYS 8.25% 15/01/23 144	25,000	27,000	0.01
USD	25,000	WPX ENERGY INC 7.5% 01/08/20	15,313	26,875	0.01
USD	25,000	CLOUD CRANE LLC 10.125% 01/08/24 14	25,000	26,750	0.01
USD	25,000	MURPHY OIL CORP 6.875% 15/08/24	25,417	26,625	0.01
USD	25,000	INTL LEASE FIN CORP 5.875% 01/04/19	26,813	26,550	0.01
USD	25,000	PINNACLE FOODS 5.875% 15/01/24 WI	25,000	26,500	0.01
USD	25,000	SCOTTS MIRACLE 6% 15/10/23 144A	25,000	26,438	0.01
USD	25,000	MPH ACQUISITION 7.125% 01/06/24 144	25,000	26,315	0.01
USD	25,000	TESORO LOGISTIC LP 6.125% 15/10/21	25,063	26,250	0.01
USD	25,000	ENGILITY CORP 8.875% 01/09/24 144A	25,000	26,188	0.01
USD	25,000	MPG HOLDCO I 7.375% 15/10/22	25,000	26,125	0.01
USD	25,000	XPO LOGISTICS 6.125% 01/09/23 144A	25,375	26,125	0.01
USD	25,000	YUM BRANDS INC 6.25% 15/03/18	27,000	26,125	0.01
USD	25,000	T-MOBILE USA INC 6.633% 28/04/21	26,094	26,094	0.01
USD	25,000	ECLIPSE RESOURCES 8.875% 15/07/23	23,563	26,094	0.01
USD	25,000	RADIO SYSTEMS 8.375% 01/11/19 144A	26,000	26,063	0.01
USD	25,000	CBS OUT AMER 5.625% 15/02/24 WI	25,938	26,063	0.01
USD	25,000	PENN NTL GAMING 5.875% 01/11/21	24,063	26,063	0.01
USD	25,000	ANIXTER INC 5.125% 01/10/21	25,000	26,000	0.01
USD	25,000	VALVOLINE FIN TWO 5.5% 15/07/24 144	25,000	25,875	0.01
USD	25,000	ISLE OF CAPRI CAS 5.875% 15/03/21	26,031	25,875	0.01
USD	25,000	COMMUNICATION SALES 6% 15/04/23 144	24,813	25,813	0.01
USD	25,000	COMMSCOPE 5.5% 15/06/24 144A	24,813	25,813	0.01
USD	25,000	JC PENNEY CORP 5.875% 1/07/23 144A	25,000	25,781	0.01
USD	25,000	ARAMARK SERV INC 5.125% 15/01/24	25,000	25,781	0.01
USD	25,000	PENSKE AUTO 5.75% 01/10/22	25,063	25,750	0.01
USD	25,000	CVR PART / NITROGE 9.25% 15/06/23 1	24,375	25,750	0.01
USD	25,000	SEALED AIR CORP 5.125% 1/12/24 144A	25,000	25,688	0.01
USD	25,000	GCI INC 6.75% 01/06/21 WI	25,781	25,625	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	CARRIZO OIL&GAS INC 6.25% 15/04/23	22,344	25,625	0.01
USD	25,000	CENTURY COMM 6.875% 15/05/22	24,565	25,625	0.01
USD	25,000	CHESAPEAKE ENERGY 8% 15/01/25 144A	24,631	25,563	0.01
USD	25,000	VERSUM MATERIALS 5.5% 30/09/24 144A	25,000	25,563	0.01
USD	25,000	ASBURY AUTO 6% 15/12/24	26,063	25,563	0.01
USD	25,000	KFC HOLD PIZZA 5% 01/06/24 144A	25,000	25,531	0.01
USD	25,000	GANNETT CO 4.875% 15/09/21 144A	24,633	25,438	0.01
USD	25,000	CEQUEL COM HLD 5.125% 15/12/21 144A	24,313	25,438	0.01
USD	25,000	NABORS INDUS 4.625% 15/09/21	24,813	25,413	0.01
USD	25,000	SM ENERGY CO 6.5% 01/01/23	23,281	25,406	0.01
USD	25,000	JONES ENERGY 9.25% 15/03/23	23,000	25,375	0.01
USD	25,000	NATIONAL CINEMED 5.75% 15/08/26 WI	25,000	25,375	0.01
USD	25,000	SCIENT GAMES 8.125% 15/9/18	25,188	25,313	0.01
USD	25,000	ALLIANCE DATA SY 5.875% 1/11/21 144	25,000	25,313	0.01
USD	25,000	TESORO CORP 5.125% 15/12/26 144A	25,000	25,285	0.01
USD	25,000	NAVISTAR INTL CORP 8.25% 01/11/21	24,625	25,250	0.01
USD	25,000	ANTERO RESOURCE 5.125% 1/12/22	22,813	25,250	0.01
USD	25,000	AMERIGAS PART/FIN 5.5% 20/05/25	25,000	25,250	0.01
USD	25,000	ANTERO MIDSTREAM 5.375% 15/09/24 14	25,000	25,250	0.01
USD	25,000	DIAMONDBACK EN 5.375% 31/05/25 144A	24,792	25,143	0.01
USD	25,000	WMG ACQUISITION 5% 01/08/23 144A	25,000	25,125	0.01
USD	24,000	COEUR D'ALENE MINES 7.875% 01/02/21	20,640	25,020	0.01
USD	25,000	SELECT MEDICAL 6.375% 01/06/21	24,639	25,000	0.01
USD	25,000	KCG HOLDINGS 6.875% 15/03/20 144A	24,313	25,000	0.01
USD	26,000	SPEEDY CASH 10.75% 15/05/18 144A	18,572	24,895	0.01
USD	25,000	NATIONSTAR MORT 6.5% 01/06/22	20,875	24,875	0.01
USD	25,000	KINDER MORGAN 5.4% 01/09/44	22,000	24,851	0.01
USD	25,000	AMERICAN MIDSTREAM 8.5% 15/12/21 14	25,000	24,844	0.01
USD	25,000	TALLGRASS NRG PRT 5.5% 15/9/24 144A	25,000	24,813	0.01
USD	25,000	MSCI INC 4.75% 01/08/26 144A	25,000	24,750	0.01
USD	25,000	ARAMARK SERV INC 4.75% 01/06/26 144	25,000	24,750	0.01
USD	25,000	UNIVERSAL HOSPITAL 7.625% 15/08/20	23,479	24,750	0.01
USD	25,000	MRT MID PART/FIN 7.25% 15/02/21	21,938	24,688	0.01
USD	25,000	SPRINT CAP CORP 6.875% 15/11/28	24,781	24,688	0.01
USD	25,000	ROSE ROCK MID 5.625% 15/07/22	12,500	24,563	0.01
USD	25,000	SIRIUS XM RADIO 5.375% 15/07/26 144	25,000	24,438	0.01
USD	25,000	SHEA HOMES LP 5.875% 01/04/23 144A	25,000	24,375	0.01
USD	25,000	SHEA HOMES LP 6.125% 01/04/25 144A	25,000	24,188	0.01
USD	25,000	WILLIAMS CIE 3.7% 15/01/23	17,375	24,125	0.01
USD	25,000	WOODSIDE HOMES CO 6.75% 15/12/21 14	24,125	24,125	0.01
USD	25,000	NRG YIELD OPER 5% 15/09/26 144A	25,000	23,875	0.01
USD	25,000	GRAPHIC PACK 4.125% 15/08/24	25,000	23,875	0.01
USD	25,000	BILL BARRETT CORP 7% 15/10/22	19,750	23,875	0.01
USD	25,000	CENTURYLINK INC 5.625% 1/04/25	24,563	23,750	0.01
USD	25,000	SANCHEZ ENERY CORP 6.125% 15/1/23	20,882	23,750	0.01
USD	23,000	CCO HLDGS LLC/CAP 5.5% 01/05/26 144	23,000	23,460	0.01
USD	25,000	EP ENERGY/EVER 9.375% 01/05/20	22,938	23,047	0.01
USD	25,000	FREEPORT-MCMORAN 3.875% 15/03/23	23,375	22,917	0.01
USD	25,000	FLEXI VAN LSG 7.875% 15/08/18 144A	25,438	22,750	0.01
USD	25,000	RESOLUTE FOREST 5.875% 15/05/23	24,125	22,438	0.01
USD	25,000	CALIFORNIA RES 8% 15/12/22 144A	21,688	22,250	0.01
USD	25,000	WEEKLEY HOMES LLC 6% 01/02/23	22,313	22,250	0.01
USD	25,000	ENDO 5.75% 15/01/22 144A	22,156	22,063	0.01
USD	25,000	HARLAND CLARKE 9.25% 01/03/21 144A	25,688	22,000	0.01
USD	100,000	RUE21 INC 9% 15/10/21 144A	80,583	22,000	0.01
USD	25,000	FREEPORT-MCMORAN 5.4% 14/11/34	22,125	20,938	0.01
USD	20,000	SOUTHERNWESTERN ENR 7.5% 01/02/18	19,663	20,800	0.01
USD	25,000	VALEANT PHARMA 6.75% 15/08/21 144A	26,156	20,750	0.01
USD	25,000	CF INDUSTRIES INC 5.375% 15/03/44	22,875	20,633	0.01
USD	21,000	HUGHES SATELITE 5.25% 01/08/26 144A	21,000	20,580	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	CLOUD PEAK ENERGY 6.375% 15/03/24	11,563	18,125	0.01
USD	16,000	ADVANCED MICRO 7.5% 15/08/22	14,840	17,280	0.01
USD	25,000	99 CENTS ONLY STORE 11% 15/12/19 WI	20,896	17,188	0.01
USD	25,000	GENON ENERGY 9.875% 15/10/20 WI	26,000	17,063	0.01
USD	15,000	ROWAN COMPANIES INC 7.375% 15/6/25	15,000	15,384	0.01
USD	13,000	CALPINE CORP 7.875% 15/01/23 144A	14,105	13,553	0.01
USD	11,000	GENWORTH FINANCIAL 7.2% 15/02/21	10,588	10,042	0.00
USD	10,000	PUERTO RICO AQUE&SE 5.125% 01/07/37	7,125	7,450	0.00
USD	10,000	IHEART COMMUNICATIONS 9% 01/03/21	8,850	7,400	0.00
USD	25,000	CLAIRE'S ST ESC 8.875% 15/3/19	15,594	4,875	0.00
USD	25,000	SABINE OIL GAS CORP 9.75% 15/02/17	11,875	0	0.00
USD	25,000	SEVENTY SEVEN ENER ESC 6.5% 15/7/22	0	0	0.00
USD	150,000	MIDWAY GAMES CV 10.75% 01/10/20 DFT	0	0	0.00
USD	200,000	MIDWAY GAMES CV 9.25% ESC 01/06/21	0	0	0.00
USD	51,000	SANDRIDGE ENERGY ESC 7.5% 15/03/21	0	0	0.00
			80,527,638	80,772,973	30.06
TBA取引					
USD	1,145,000	FNCL 30YR TBA 4% 18/01/17 REG A	1,200,592	1,202,965	0.44
USD	860,000	FGLMC 30YR TBA 4% 18/01/17 REG A	901,509	902,731	0.33
USD	665,000	FNCL 30YR TBA 3% 18/01/17 REG A	660,436	659,597	0.24
USD	420,000	FGLMC 30YR TBA 3% 18/01/17 REG A	417,276	416,194	0.15
USD	380,000	G2SF 30YR TBA 3% 24/01/17 REG C	385,174	384,038	0.14
USD	225,000	FGCI 15YR TBA 3% 23/01/17 REG B	230,941	230,766	0.09
USD	155,000	FNCI 15YR TBA 3% 23/01/17 REG B	159,190	158,923	0.06
USD	130,000	FGCI 15YR TBA 2.5% 23/01/17 REG B	130,208	130,081	0.05
USD	125,000	FNCI 15YR TBA 2.5% 23/01/17 REG B	125,293	125,078	0.05
USD	90,000	FNCL 30YR TBA 4.5% 18/01/17 REG A	96,648	96,722	0.04
USD	90,000	G2SF 30YR TBA 4% 24/01/17	95,310	95,513	0.04
USD	80,000	FNCL 30YR TBA 3.5% 18/01/17 REG A	82,025	81,900	0.03
USD	65,000	G2SF 30YR TBA 3.5% 24/01/17 REG C	67,318	67,519	0.03
			4,551,920	4,552,027	1.69
短期国庫債券					
USD	1,000,000	US TREAS BILL 0% 26/01/17	999,613	999,736	0.37
			999,613	999,736	0.37
優先証券					
--	15,925	GMAC CAP TST I PFD FRN 15/02/40	402,680	403,699	0.15
--	733	COWEN GROUP PFD 8.25% 15/10/21	18,325	18,845	0.01
			421,005	422,544	0.16
国債					
USD	6,300,000	US TREAS NOTE 0.125% 15/07/26 (CPI)	6,167,089	6,131,934	2.27
USD	865,000	US TREAS NOTE 3.875% 15/04/29 (CPI)	1,818,656	1,735,336	0.65
USD	1,400,000	US TREAS NOTE 3.625% 15/08/43	1,609,817	1,547,875	0.58
USD	770,000	US TREAS NOTE 3.75% 15/11/43	935,350	869,739	0.32
USD	550,000	US TREAS NOTE 0.625% 15/01/26 (CPI)	571,600	563,247	0.21
USD	500,000	US TREAS NOTE 0.125% 15/04/18 (CPI)	516,427	527,436	0.20
USD	460,000	US TREAS NOTE 2% 31/12/21	458,761	461,222	0.17
USD	300,000	US TREAS NOTE 0.125% 15/04/20 (CPI)	311,496	312,621	0.12
USD	300,000	US TREAS NOTE 0.125% 15/01/23 CPI	308,249	311,451	0.12
USD	175,000	US TREAS NOTE 2.5% 15/01/29 (CPI)	247,943	237,080	0.09
USD	200,000	US TREAS NOTE 3.625% 15/02/44	238,109	220,875	0.08
USD	200,000	US TREAS NOTE 0.125% 15/04/19 (CPI)	206,263	208,774	0.08
USD	85,000	US TREAS NOTE 3.625% 15/04/28 (CPI)	172,864	166,643	0.06
USD	90,000	US TREAS NOTE 2% 15/01/26 (CPI)	126,725	123,253	0.05
USD	100,000	US TREAS NOTE 0.125% 15/01/22 (CPI)	103,367	106,860	0.04
USD	60,000	US TREAS NOTE 2.375% 15/08/24	61,125	60,150	0.02
USD	20,000	US TREAS NOTE 1.75% 30/09/22	20,359	19,594	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	10,000	US TREAS NOTE 1.875% 31/10/22	10,255	9,853	0.00
USD	5,000	US TREAS NOTE 3.875% 15/08/40	5,663	5,724	0.00
			<u>13,890,118</u>	<u>13,619,667</u>	<u>5.07</u>
ワラント					
--	1,138	MIDSTATES PETROLEUM CO INC WTS 2020	70,676	2,048	0.00
--	583	HALCON RESOURCES WTS 2020	2,506	1,207	0.00
--	99	SANDRIDGE ENERGY INC WTS 2022	0	347	0.00
--	41	SANDRIDGE ENERGY INC WTS 2022	0	166	0.00
			<u>73,182</u>	<u>3,768</u>	<u>0.00</u>
		合計: アメリカ	<u>210,828,212</u>	<u>209,496,679</u>	<u>77.95</u>
		組入資産合計	<u>262,345,263</u>	<u>255,489,562</u>	<u>95.05</u>

⁽¹⁾ 額面価格は発行通貨建て表示

財務書類に関する注記

2016年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

2016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)
JPY	12,837,953	USD	108,706	2017年1月12日	1,021
JPY	10,572,775	USD	90,064	2017年1月25日	373
JPY	10,578,403	USD	90,064	2017年1月12日	350
JPY	184,596	USD	1,622	2017年1月12日	(45)
JPY	1,062,499	USD	9,321	2017年1月12日	(240)
JPY	4,207,027	USD	36,401	2017年1月12日	(443)
USD	17,562,066	EUR	15,850,000	2017年1月19日	865,869
USD	869,235	EUR	774,875	2017年1月12日	53,314
EUR	739,000	USD	810,242	2017年1月19日	(31,789)
EUR	1,900,000	USD	2,043,286	2017年1月19日	(41,850)
BRL	94,800,000	USD	27,613,929	2017年2月2日	1,225,891
ZAR	94,100,000	USD	6,403,691	2017年1月25日	438,469
MXN	288,500,000	USD	13,689,205	2017年1月25日	184,694
ZAR	26,500,000	USD	1,849,012	2017年1月25日	77,845
ZAR	16,300,000	USD	1,147,552	2017年1月25日	37,646
TRY	28,200,000	USD	7,865,999	2017年2月23日	34,895
INR	686,000,000	USD	10,008,169	2017年2月23日	33,549
INR	672,000,000	USD	9,838,225	2017年1月25日	30,798
ZAR	185,800,000	USD	13,415,162	2017年2月23日	24,614
ZAR	11,600,000	USD	820,864	2017年2月23日	18,218
INR	79,000,000	USD	1,147,206	2017年1月25日	12,992
INR	77,000,000	USD	1,122,582	2017年1月25日	8,243
INR	55,000,000	USD	800,106	2017年1月25日	7,626
USD	796,434	ZAR	10,900,000	2017年1月25日	3,878
USD	956,357	ZAR	13,100,000	2017年1月25日	3,836
USD	605,166	INR	41,000,000	2017年1月25日	3,038
TRY	4,300,000	USD	1,296,574	2017年1月25日	(84,523)
MXN	183,000,000	USD	8,889,104	2017年2月23日	(120,211)
TRY	28,200,000	USD	8,467,197	2017年1月25日	(518,390)
JPY	710,947,846	USD	6,062,011	2017年1月25日	19,270
USD	121,218	JPY	13,962,577	2017年1月12日	1,879
USD	10,454	JPY	1,228,492	2017年1月12日	(45)
USD	10,454	JPY	1,227,802	2017年1月25日	(47)
USD	11,246	JPY	1,321,458	2017年1月12日	(48)
USD	11,246	JPY	1,320,716	2017年1月25日	(51)
JPY	706,662,751	USD	6,210,869	2017年1月12日	(170,953)
USD	3,897,014	JPY	397,820,871	2017年1月11日	497,001
USD	3,885,614	JPY	397,820,871	2017年1月11日	485,602
USD	6,804,112	NZD	9,300,000	2017年1月19日	345,335
USD	2,998,468	JPY	312,000,000	2017年1月19日	330,654
USD	2,500,000	JPY	265,440,000	2017年1月19日	230,306
BRL	9,060,000	USD	2,608,218	2017年2月2日	147,993
USD	2,370,329	CHF	2,300,000	2017年1月19日	112,222
USD	1,514,495	PLN	5,940,000	2017年1月19日	101,005
USD	1,811,394	KRW	2,072,000,000	2017年1月19日	88,959
RUB	78,800,000	USD	1,215,861	2017年1月19日	71,631
ZAR	24,919,475	USD	1,750,000	2017年1月19日	64,155
USD	1,465,767	CNH	10,000,000	2017年1月19日	42,335

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	1,250,000	NOK	10,499,929	2017年1月19日	33,666
USD	1,150,000	JPY	131,465,125	2017年1月19日	25,883
USD	2,652,019	ILS	10,100,000	2017年1月19日	23,739
USD	1,250,664	GBP	1,000,000	2017年1月19日	21,171
USD	525,419	SGD	730,000	2017年1月19日	20,911
USD	739,467	AUD	999,101	2017年3月15日	19,734
USD	1,804,332	SEK	16,200,000	2017年1月19日	19,619
USD	621,375	TWD	19,500,000	2017年1月19日	17,489
SEK	8,772,897	EUR	902,129	2017年3月15日	16,472
USD	855,189	GBP	684,000	2017年1月6日	14,524
USD	839,657	GBP	671,577	2017年1月6日	14,260
USD	487,853	GBP	385,188	2017年3月15日	13,646
USD	263,170	KRW	300,854,050	2017年1月13日	13,072
USD	1,421,012	CAD	1,900,000	2017年1月19日	12,381
EUR	934,294	USD	973,327	2017年2月9日	11,882
USD	385,045	GBP	304,016	2017年3月15日	10,770
USD	600,000	KRW	708,840,000	2017年1月19日	10,747
USD	312,833	AUD	419,000	2017年1月12日	10,549
USD	600,000	KRW	709,140,000	2017年1月19日	10,498
USD	314,696	NZD	439,063	2017年3月15日	10,266
USD	333,162	TWD	10,459,297	2017年1月13日	9,341
SEK	5,018,810	EUR	516,479	2017年3月15日	9,014
USD	289,929	KRW	338,707,750	2017年1月20日	8,363
RUB	8,735,691	USD	134,250	2017年1月26日	8,269
USD	568,443	TWD	18,087,881	2017年1月20日	8,257
USD	291,370	CAD	382,426	2017年3月15日	7,662
USD	246,844	JPY	28,012,682	2017年3月21日	6,609
SEK	3,846,660	EUR	396,419	2017年3月15日	6,312
SEK	2,744,776	EUR	281,170	2017年3月15日	6,293
SEK	2,589,255	EUR	265,276	2017年3月22日	5,908
USD	247,183	KRW	291,003,938	2017年1月19日	5,274
USD	211,718	KRW	248,479,457	2017年1月19日	5,160
USD	180,025	JPY	20,429,842	2017年3月21日	4,820
USD	171,678	GBP	135,869	2017年3月15日	4,409
USD	337,597	JPY	38,890,412	2017年3月15日	4,196
USD	253,780	JPY	29,123,005	2017年3月15日	4,113
USD	245,586	TWD	7,752,679	2017年6月16日	3,971
USD	237,387	SGD	337,910	2017年3月15日	3,920
EUR	666,926	USD	700,629	2017年3月15日	3,831
RUB	4,097,625	USD	63,113	2017年1月26日	3,738
USD	118,022	CAD	154,418	2017年1月20日	3,538
USD	198,606	CNH	1,387,960	2017年3月15日	3,457
RUB	3,862,468	USD	59,633	2017年1月26日	3,381
RUB	3,926,570	USD	61,000	2017年1月26日	3,061
USD	118,990	AUD	161,000	2017年3月15日	3,009
USD	246,161	TWD	7,856,248	2017年1月12日	2,936
USD	104,091	JPY	11,812,642	2017年3月21日	2,787
EUR	114,000	GBP	95,709	2017年3月15日	2,587
USD	445,482	CAD	596,961	2017年3月22日	2,578
USD	245,776	TWD	7,856,248	2017年1月12日	2,551
USD	246,028	TRY	873,276	2017年3月15日	2,470
USD	130,443	IDR	1,727,730,180	2017年1月12日	2,460
USD	85,737	NOK	721,532	2017年3月15日	2,127
PLN	1,393,752	EUR	311,696	2017年3月15日	2,122
USD	60,466	AUD	81,000	2017年3月15日	2,115
USD	124,862	TWD	3,941,920	2017年6月16日	2,011
BRL	283,996	USD	84,449	2017年2月2日	1,947
USD	66,896	KRW	78,220,423	2017年1月19日	1,873
USD	59,458	AUD	80,000	2017年3月15日	1,828
USD	63,827	KRW	74,615,450	2017年1月13日	1,800
USD	121,806	KRW	144,371,657	2017年2月9日	1,788

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	61,000	KRW	71,248,000	2017年1月13日	1,772
USD	60,000	KRW	70,068,600	2017年1月13日	1,752
USD	59,289	NZD	83,000	2017年3月15日	1,740
USD	59,694	KRW	69,746,412	2017年1月19日	1,715
USD	60,000	KRW	70,157,455	2017年1月19日	1,679
USD	59,476	GBP	47,000	2017年3月15日	1,614
USD	57,006	KRW	66,640,014	2017年1月19日	1,609
USD	63,000	MXN	1,286,176	2017年3月15日	1,528
USD	38,352	KRW	44,430,075	2017年1月13日	1,418
USD	63,925	TWD	2,019,726	2017年1月13日	1,394
USD	87,207	MYR	385,261	2017年1月12日	1,367
USD	85,528	CAD	113,545	2017年1月20日	1,347
RUB	3,697,530	USD	59,000	2017年1月26日	1,324
USD	227,762	TWD	7,265,629	2017年6月20日	1,287
USD	60,360	GBP	48,000	2017年3月15日	1,267
USD	61,134	CNH	425,891	2017年3月15日	1,253
SEK	555,522	EUR	57,000	2017年3月15日	1,175
USD	29,859	NZD	41,351	2017年1月9日	1,131
SEK	545,386	EUR	56,000	2017年3月15日	1,112
JPY	14,126,580	USD	120,000	2017年3月15日	1,105
USD	78,858	GBP	63,161	2017年3月15日	1,100
USD	60,000	KRW	70,869,600	2017年1月19日	1,087
USD	191,457	TWD	6,107,500	2017年6月20日	1,082
USD	27,709	AUD	36,908	2017年1月12日	1,082
ZAR	514,159	USD	36,000	2017年3月15日	1,061
SEK	553,711	EUR	57,000	2017年3月15日	975
USD	60,000	MXN	1,235,029	2017年3月15日	972
USD	61,000	TWD	1,939,263	2017年1月13日	960
USD	61,000	TWD	1,939,843	2017年1月13日	942
USD	60,000	CAD	79,665	2017年3月15日	899
USD	61,000	CNH	427,782	2017年3月15日	853
EUR	54,720	USD	56,948	2017年3月15日	851
USD	120,000	JPY	13,898,832	2017年3月15日	847
USD	59,000	MXN	1,217,358	2017年3月15日	817
JPY	15,258,587	USD	130,000	2017年3月15日	810
RUB	3,665,670	USD	59,000	2017年1月26日	804
USD	60,000	MXN	1,238,595	2017年3月15日	802
USD	52,950	KRW	62,756,340	2017年1月19日	781
USD	59,000	MXN	1,218,160	2017年3月15日	779
USD	60,000	TWD	1,912,320	2017年1月20日	775
SEK	1,280,000	USD	140,314	2017年1月27日	768
USD	60,000	TWD	1,912,932	2017年1月20日	756
JPY	7,084,716	USD	60,000	2017年3月15日	736
USD	60,000	CNH	421,680	2017年3月15日	711
EUR	56,000	USD	58,450	2017年3月15日	701
EUR	56,000	USD	58,475	2017年3月15日	676
USD	59,827	EUR	56,000	2017年3月15日	676
ZAR	342,012	USD	24,000	2017年3月15日	653
JPY	7,072,626	USD	60,000	2017年3月15日	633
EUR	57,000	USD	59,630	2017年3月15日	577
PHP	6,410,547	USD	128,609	2017年1月19日	565
RUB	3,711,300	USD	60,000	2017年1月26日	548
HUF	16,607,048	EUR	52,774	2017年3月16日	547
JPY	7,062,030	USD	60,000	2017年3月15日	542
USD	119,000	SGD	171,452	2017年3月15日	541
SEK	282,112	EUR	29,000	2017年3月15日	540
EUR	52,685	USD	55,114	2017年3月15日	536
JPY	6,941,645	USD	59,000	2017年3月15日	510
USD	57,662	CNH	402,284	2017年1月23日	486
USD	62,936	ILS	239,695	2017年3月15日	459
CHF	171,214	EUR	159,269	2017年3月15日	420

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	27,000	CLP	17,797,320	2017年1月19日	397
USD	20,137	NOK	170,439	2017年1月27日	392
USD	61,000	IDR	818,315,000	2017年1月12日	382
ARS	425,985	USD	26,222	2017年1月6日	372
USD	18,000	CAD	23,794	2017年3月15日	348
USD	58,000	JPY	6,725,448	2017年3月15日	344
CAD	78,632	USD	58,000	2017年3月15日	335
USD	58,000	JPY	6,727,246	2017年3月15日	328
USD	53,079	CNH	370,756	2017年1月20日	324
USD	60,520	EUR	57,000	2017年3月15日	313
SEK	492,328	USD	53,951	2017年1月27日	313
USD	58,000	JPY	6,729,276	2017年3月15日	311
PLN	250,104	EUR	56,000	2017年3月15日	310
JPY	6,916,959	USD	59,000	2017年3月15日	298
USD	60,938	EUR	57,413	2017年3月15日	294
KRW	142,298,560	USD	118,000	2017年1月19日	292
EUR	31,408	USD	32,890	2017年3月15日	286
USD	37,532	MYR	167,224	2017年1月19日	282
RUB	3,693,300	USD	60,000	2017年1月26日	255
CNY	370,756	USD	53,079	2017年1月20日	237
MYR	337,142	USD	74,887	2017年1月12日	232
USD	77,755	CNH	553,153	2017年4月5日	208
CNY	402,486	USD	57,662	2017年1月23日	208
USD	59,000	JPY	6,858,632	2017年3月15日	202
USD	14,915	PLN	62,000	2017年1月26日	164
AUD	81,000	NZD	83,932	2017年3月15日	155
CLP	18,702,642	USD	27,802	2017年1月19日	153
ARS	328,902	USD	20,030	2017年1月25日	143
ARS	287,450	USD	17,825	2017年1月6日	120
ARS	645,287	USD	39,722	2017年1月18日	118
EUR	21,840	HUF	6,772,038	2017年3月16日	115
EUR	11,407	CZK	304,931	2017年6月21日	98
CZK	3,296,440	EUR	122,226	2017年6月21日	97
USD	58,000	JPY	6,755,306	2017年3月15日	88
KRW	155,181,883	USD	128,920	2017年1月20日	81
USD	59,000	TRY	211,253	2017年3月15日	81
CLP	36,031,781	USD	53,778	2017年1月19日	80
USD	58,000	KRW	69,674,472	2017年1月31日	80
INR	15,589,956	USD	228,759	2017年1月30日	76
USD	59,142	AUD	82,000	2017年3月15日	71
USD	58,000	CAD	78,092	2017年3月15日	66
NOK	510,999	EUR	56,000	2017年3月15日	63
EUR	57,000	PLN	252,981	2017年3月15日	62
RUB	3,680,766	USD	60,000	2017年1月26日	50
USD	59,669	NZD	86,000	2017年3月15日	40
INR	1,448,029	USD	21,266	2017年1月9日	35
CHF	61,153	EUR	57,000	2017年3月15日	31
CZK	1,644,682	EUR	61,000	2017年6月21日	29
NOK	510,699	EUR	56,000	2017年3月15日	28
USD	59,000	RUB	3,615,171	2017年1月26日	20
CZK	1,644,407	EUR	61,000	2017年6月21日	18
USD	59,000	IDR	798,199,200	2017年1月27日	16
CAD	79,539	USD	59,000	2017年3月15日	7
MYR	52,507	USD	11,689	2017年1月19日	7
CZK	1,541,596	EUR	57,578	2017年11月22日	2
USD	61,129	MXN	1,279,157	2017年3月15日	(7)
JPY	6,764,540	USD	58,000	2017年3月15日	(9)
KRW	70,953,400	USD	59,000	2017年1月31日	(17)
USD	59,000	JPY	6,888,368	2017年3月15日	(53)
USD	165,649	HUF	48,883,033	2017年3月16日	(54)
JPY	5,600,122	EUR	45,505	2017年3月15日	(58)

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)
NOK	509,956	EUR	56,000	2017年3月15日	(58)
USD	58,000	CAD	78,266	2017年3月15日	(63)
GBP	47,000	USD	57,931	2017年3月15日	(69)
CZK	1,546,895	EUR	57,849	2017年11月21日	(78)
NOK	509,694	EUR	56,000	2017年3月15日	(89)
ZAR	331,725	USD	24,000	2017年3月15日	(89)
TWD	1,902,160	USD	59,000	2017年1月20日	(90)
EUR	56,000	SEK	536,160	2017年3月15日	(92)
USD	59,000	JPY	6,893,029	2017年3月15日	(93)
JPY	6,753,462	USD	58,000	2017年3月15日	(104)
AUD	82,000	USD	59,178	2017年3月15日	(107)
JPY	6,057,170	EUR	49,285	2017年3月15日	(132)
USD	124,729	INR	8,506,583	2017年1月30日	(133)
HUF	17,723,010	EUR	57,000	2017年3月16日	(134)
KRW	41,883,205	USD	35,000	2017年1月20日	(183)
USD	59,000	RUB	3,628,470	2017年1月26日	(197)
CZK	1,397,111	EUR	52,248	2017年9月21日	(213)
COP	71,390,557	USD	23,913	2017年1月17日	(220)
USD	59,000	RUB	3,629,975	2017年1月26日	(222)
INR	6,681,409	USD	98,299	2017年1月30日	(227)
USD	128,239	INR	8,752,366	2017年1月30日	(231)
USD	59,000	JPY	6,909,637	2017年3月15日	(235)
IDR	236,598,666	USD	17,749	2017年1月17日	(238)
USD	59,461	EUR	56,520	2017年3月15日	(241)
JPY	6,044,528	EUR	49,285	2017年3月15日	(241)
COP	255,386,175	USD	84,845	2017年1月26日	(243)
GBP	48,000	USD	59,351	2017年3月15日	(259)
IDR	320,640,000	USD	24,000	2017年1月17日	(268)
USD	59,000	JPY	6,913,974	2017年3月15日	(273)
CZK	1,621,200	EUR	60,424	2017年6月21日	(285)
USD	58,845	EUR	56,000	2017年3月15日	(306)
NZD	22,000	USD	15,609	2017年1月9日	(325)
USD	59,000	JPY	6,920,228	2017年3月15日	(326)
NOK	516,683	EUR	57,000	2017年3月15日	(335)
TWD	1,893,900	USD	59,000	2017年1月20日	(345)
ZAR	1,173,573	USD	84,943	2017年3月15日	(350)
USD	59,000	JPY	6,925,833	2017年3月15日	(374)
USD	58,776	EUR	56,000	2017年3月15日	(375)
JPY	2,399,000	USD	20,880	2017年1月11日	(378)
USD	59,815	EUR	57,000	2017年3月15日	(393)
USD	59,812	EUR	57,000	2017年3月15日	(396)
GBP	47,689	EUR	56,000	2017年3月15日	(441)
CNH	416,472	USD	59,000	2017年3月15日	(443)
MYR	246,651	USD	55,386	2017年1月19日	(444)
EUR	57,000	PLN	255,171	2017年3月15日	(458)
CNH	416,355	USD	59,000	2017年3月15日	(460)
USD	59,743	EUR	57,000	2017年3月15日	(464)
USD	60,000	JPY	7,053,366	2017年3月15日	(468)
EUR	56,023	SEK	539,863	2017年3月15日	(477)
CAD	80,222	USD	60,000	2017年3月15日	(486)
EUR	57,000	SEK	549,285	2017年3月15日	(486)
USD	24,000	ZAR	339,850	2017年3月15日	(497)
GBP	48,000	JPY	6,951,120	2017年3月15日	(498)
CAD	80,202	USD	60,000	2017年3月15日	(500)
KRW	70,365,229	USD	59,000	2017年1月20日	(506)
CNH	997,808	USD	140,829	2017年3月15日	(536)
USD	64,463	PHP	3,226,080	2017年1月19日	(543)
CAD	78,794	USD	59,000	2017年3月15日	(545)
USD	59,000	JPY	6,945,952	2017年3月15日	(547)
USD	59,000	JPY	6,946,040	2017年3月15日	(547)
IDR	803,191,200	USD	60,000	2017年1月17日	(553)

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)
MXN	5,254,009	USD	253,455	2017年1月19日	(567)
CNH	403,451	USD	57,306	2017年3月15日	(580)
TWD	1,918,050	USD	60,000	2017年1月19日	(601)
AUD	81,000	USD	58,955	2017年3月15日	(605)
EUR	57,000	HUF	17,942,460	2017年3月16日	(610)
CAD	80,051	USD	60,000	2017年3月15日	(613)
USD	120,000	JPY	14,070,720	2017年3月15日	(626)
EUR	49,532	USD	52,956	2017年3月15日	(636)
CNH	429,226	USD	61,000	2017年3月15日	(650)
USD	59,557	EUR	57,000	2017年3月15日	(651)
EUR	57,000	SEK	551,056	2017年3月15日	(682)
CZK	4,088,387	EUR	152,957	2017年9月20日	(701)
MXN	1,219,075	USD	59,000	2017年3月15日	(735)
USD	59,000	PHP	2,965,255	2017年1月19日	(751)
PLN	3,431,161	USD	816,554	2017年3月15日	(805)
MXN	1,847,908	USD	89,142	2017年3月15日	(823)
KRW	71,124,000	USD	60,000	2017年1月19日	(875)
IDR	1,135,084,042	USD	84,961	2017年1月12日	(878)
TWD	3,911,174	USD	122,000	2017年1月13日	(909)
NOK	363,271	USD	43,035	2017年1月27日	(950)
TWD	1,959,816	USD	61,648	2017年1月20日	(953)
GBP	48,000	USD	60,063	2017年3月15日	(970)
TRY	548,632	USD	154,000	2017年3月15日	(985)
KRW	74,209,440	USD	62,738	2017年1月19日	(1,049)
USD	193,611	SEK	1,766,194	2017年1月27日	(1,060)
JPY	6,871,980	USD	60,000	2017年3月15日	(1,087)
TWD	3,748,217	USD	117,179	2017年1月12日	(1,136)
AUD	81,000	USD	59,489	2017年3月15日	(1,139)
TWD	3,514,544	USD	110,000	2017年1月20日	(1,153)
TWD	2,626,490	USD	82,513	2017年1月12日	(1,199)
EUR	201,556	SEK	1,937,773	2017年3月15日	(1,217)
JPY	11,421,185	EUR	93,877	2017年3月15日	(1,248)
GBP	100,000	USD	124,251	2017年1月19日	(1,302)
AUD	81,000	USD	59,681	2017年3月15日	(1,331)
NZD	183,933	USD	128,909	2017年3月15日	(1,377)
USD	119,000	RUB	7,382,165	2017年1月26日	(1,437)
USD	119,962	EUR	115,000	2017年3月15日	(1,510)
CAD	78,569	USD	60,000	2017年3月15日	(1,712)
USD	60,000	RUB	3,792,000	2017年1月26日	(1,865)
NOK	1,022,967	EUR	114,000	2017年3月15日	(1,875)
GBP	46,225	USD	58,800	2017年1月6日	(1,988)
AUD	81,000	USD	60,351	2017年3月15日	(2,000)
IDR	1,198,275,627	USD	90,847	2017年1月9日	(2,048)
KRW	118,121,165	USD	100,495	2017年1月19日	(2,303)
USD	61,000	RUB	3,880,972	2017年1月26日	(2,317)
USD	61,000	RUB	3,891,495	2017年1月26日	(2,488)
GBP	151,078	USD	188,239	2017年1月6日	(2,558)
JPY	4,009,537	USD	36,883	2017年1月11日	(2,616)
USD	61,000	RUB	3,903,390	2017年1月26日	(2,682)
USD	175,687	CLP	119,481,395	2017年1月19日	(2,908)
CAD	261,724	USD	197,145	2017年1月20日	(3,104)
USD	527,980	EUR	502,972	2017年3月15日	(3,299)
NOK	2,065,817	EUR	229,995	2017年3月15日	(3,554)
IDR	2,357,436,020	USD	178,796	2017年1月12日	(4,166)
GBP	471,778	USD	584,345	2017年1月6日	(4,509)
GBP	318,113	USD	395,923	2017年1月6日	(4,949)
MXN	5,495,685	USD	268,219	2017年3月15日	(5,556)
GBP	303,165	USD	378,529	2017年1月6日	(5,926)
NZD	305,523	USD	218,221	2017年3月15日	(6,383)
MXN	6,277,504	USD	306,593	2017年3月15日	(6,564)
MXN	6,204,520	USD	303,585	2017年3月15日	(7,043)

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	920,000	MXN	19,270,320	2017年1月19日	(7,528)
AUD	457,795	USD	341,799	2017年1月12日	(11,526)
ZAR	23,867,375	USD	1,750,000	2017年1月19日	(12,439)
NZD	1,300,000	USD	917,400	2017年1月19日	(14,561)
NZD	1,600,000	USD	1,126,955	2017年1月19日	(15,768)
MXN	18,780,880	USD	920,000	2017年1月19日	(16,030)
INR	140,000,000	USD	2,079,619	2017年1月19日	(22,353)
NOK	10,510,000	USD	1,250,000	2017年1月19日	(32,499)
USD	2,737,792	EUR	2,628,000	2017年2月9日	(33,421)
JPY	129,963,225	USD	1,150,000	2017年1月19日	(38,725)
USD	800,000	ZAR	11,588,640	2017年1月19日	(43,661)
MXN	24,920,375	USD	1,250,000	2017年1月19日	(50,521)
JPY	42,019,787	USD	415,000	2017年1月19日	(55,702)
JPY	42,016,882	USD	415,000	2017年1月19日	(55,727)
KRW	1,796,140,000	USD	1,550,000	2017年1月19日	(56,884)
JPY	42,391,650	USD	420,000	2017年1月19日	(57,522)
USD	1,750,000	ZAR	24,902,500	2017年1月19日	(62,919)
NOK	25,800,000	USD	3,134,620	2017年1月19日	(145,894)
AUD	6,200,000	USD	4,768,227	2017年1月19日	(296,142)
					4,041,199

注記2 - 先物契約

2016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	6	FUT 90 DAY EURODOLLAR	2017年3月	1,484,325	75
GBP	18	FUT 90 DAY STERLING	2017年12月	2,751,805	1,444
GBP	18	FUT 90 DAY STERLING	2017年6月	2,753,188	706
GBP	18	FUT 90 DAY STERLING	2017年3月	2,753,879	707
GBP	18	FUT 90 DAY STERLING	2017年9月	2,752,635	1,091
AUD	72	FUT AUST 3YR BOND 6%	2017年3月	5,792,095	(5,610)
CAD	2	FUT CAN BD 10YR 6%	2017年3月	203,810	1,209
EUR	36	FUT EURO BUND 10YR 6%	2017年3月	6,217,875	101,811
USD	3	FUT GBP CURRENCY	2017年3月	231,675	(4,681)
GBP	5	FUT LONG GILT 10YR 4%	2017年3月	773,100	12,227
USD	1	FUT SEK CURRENCY	2017年3月	221,300	2,678
USD	7	FUT US LONG BD 20YR 6%	2017年3月	1,052,188	(12,701)
USD	18	FUT US ULTRA NOTE 10YR 6%	2017年3月	2,407,781	(15,103)
				<u>29,395,656</u>	<u>83,853</u>
<i>売り持ちポジション</i>					
JPY	(40)	FUT 10YR MINI JGB	2017年3月	(5,133,823)	(3,076)
USD	(2)	FUT 90 DAY EURODOLLAR	2018年12月	(489,925)	2,050
USD	(1)	FUT 90 DAY EURODOLLAR	2019年12月	(244,150)	1,250
USD	(1)	FUT 90 DAY EURODOLLAR	2019年3月	(244,738)	1,138
USD	(2)	FUT 90 DAY EURODOLLAR	2018年9月	(490,575)	1,750
USD	(1)	FUT 90 DAY EURODOLLAR	2019年9月	(244,350)	1,213
USD	(1)	FUT 90 DAY EURODOLLAR	2019年6月	(244,525)	1,180
GBP	(70)	FUT 90 DAY STERLING	2017年12月	(10,701,466)	(91,392)
CAD	(25)	FUT CAN BD 10YR 6%	2017年3月	(2,547,620)	24,644
USD	(3)	FUT CANADIAN DOLLAR	2017年3月	(223,620)	(1,950)
EUR	(12)	FUT EUR OAT	2017年3月	(1,916,941)	(17,540)
EUR	(47)	FUT EURO BOBL 5YR 6%	2017年3月	(6,608,462)	(42,372)
EUR	(51)	FUT EURO BUND 10YR 6%	2017年3月	(8,808,656)	(102,968)
EUR	(3)	FUT EURO BUXL 30YR 4%	2017年3月	(547,734)	7,828
USD	(7)	FUT EURO FX CURRENCY	2017年3月	(926,581)	(1,504)
USD	(19)	FUT FED FUND 30DAY	2017年4月	(7,861,087)	517
JPY	(1)	FUT JPN 10YR BD 6% (OSE)	2017年3月	(1,283,114)	769
GBP	(5)	FUT LONG GILT 10YR 4%	2017年3月	(773,100)	(15,053)
USD	(3)	FUT MXN CURRENCY	2017年3月	(72,060)	930
USD	(1)	FUT NEW ZEALAND DOLLAR	2017年3月	(69,410)	1,751
USD	(13)	FUT SOUTH AFRICAN RAND	2017年3月	(468,325)	(5,799)
USD	(37)	FUT US LONG BD 20YR 6%	2017年3月	(5,561,563)	(1,249)
USD	(61)	FUT US NOTE 10YR 6%	2017年3月	(7,569,719)	25,655
USD	(86)	FUT US NOTE 2YR 6%	2017年3月	(18,631,093)	9,531
USD	(98)	FUT US NOTE 5YR 6%	2017年3月	(11,520,360)	6,786
USD	(9)	FUT US ULTRA BOND 30YR 6%	2017年3月	(1,437,750)	9,243
USD	(7)	FUT US ULTRA NOTE 10YR 6%	2017年3月	(936,359)	5,183
				<u>(95,557,106)</u>	<u>(181,485)</u>
					<u>(97,632)</u>

注記3 - 金利スワップ契約

2016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)
SEK	19,010,000	Receive Fixed (0.05%) - Pay Floating (3M SEK-STIBOR)	2018年6月15日	566	13,833
SEK	14,490,000	Receive Fixed (-0.33%) - Pay Floating (3M SEK-STIBOR)	2018年9月15日	0	(341)
SEK	3,590,000	Receive Floating (3M SEK-STIBOR) - Pay Fixed (1.25)%	2027年3月15日	0	(3,589)
SEK	18,710,000	Receive Floating (3M SEK-STIBOR) - Pay Fixed (0.5%)	2022年3月15日	0	(16,577)
NZD	5,280,000	Receive Fixed (2.35%) - Pay Floating (3M NZD LIBOR)	2019年2月22日	0	(12,904)
NZD	1,330,000	Receive Fixed (3.00%) - Pay Floating (3M NZD LIBOR)	2022年3月15日	0	(4,869)
CAD	2,690,000	Receive Fixed (1.25%) - Pay Floating (3M CAD)	2022年3月15日	0	(24,631)
CAD	7,540,000	Receive Fixed (1.00%) - Pay Floating (3M CAD)	2019年3月15日	0	(16,354)
GBP	520,000	Receive Floating (6M GBP LIBOR) - Pay Fixed (1.50%)	2027年3月15日	0	(14,690)
GBP	870,000	Receive Floating (6M GBP LIBOR) - Pay Fixed (1.75%)	2032年3月15日	0	(48,361)
GBP	280,000	Receive Floating (6M GBP LIBOR) - Pay Fixed (1.75%)	2047年3月15日	0	(28,084)
GBP	4,690,000	Receive Fixed (0.60%) - Pay Floating (3M GBP LIBOR)	2019年3月15日	0	(6,296)
USD	500,000	Receive Fixed (1.75%) - Pay Floating (3M USD LIBOR)	2027年3月15日	0	(27,123)
USD	2,090,000	Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (1.50%)	2022年3月15日	0	49,492
USD	450,000	Receive Fixed (2.25%) - Pay Floating (3M USD LIBOR)	2047年3月15日	0	(30,362)
USD	7,970,000	Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (1.25%)	2019年3月15日	0	38,418
USD	4,440,000	Receive Fixed (2.25%) - Pay Floating (3M USD LIBOR)	2019年12月19日	0	7,203
USD	1,010,000	Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (2.60%)	2023年12月19日	0	(7,581)
USD	1,230,000	Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (2.79%)	2028年12月20日	0	(17,630)
USD	8,680,000	Receive Fixed (2.25%) - Pay Floating (3M USD LIBOR)	2019年12月20日	0	13,899
MXN	6,070,000	Receive Fixed (6.00%) - Pay Floating (MXN TIE BANXICO)	2027年3月3日	0	(40,238)
MXN	800,000	Receive Floating (MXN TIE BANXICO) - Pay Fixed (5.50%)	2022年3月9日	0	3,528
MXN	1,340,000	Receive Fixed (5.25%) - Pay Floating (MXN TIE BANXICO)	2020年3月11日	0	(3,904)
JPY	24,710,000	Receive Floating (JPY LIBOR 6M) - Pay Fixed (0.75%)	2037年3月15日	0	(4,021)
PLN	2,770,000	Receive Fixed (1.77144%) - Pay Floating (WIBOR PLN 6M)	2021年9月21日	139	(17,177)
EUR	250,000	Receive Fixed (0.25%) - Pay Floating (6M EUR-EURIBOR)	2024年8月16日	0	(5,511)
EUR	450,000	Receive Fixed (0.075) - Pay Floating (6M EUR-EURIBOR)	2027年3月15日	0	2,515
EUR	600,000	Receive Floating (6M EUR-EURIBOR) - Pay Fixed (0.00%)	2022年3月15日	0	3,729
EUR	1,170,000	Receive Floating (6M EUR-EURIBOR) - Pay Fixed (1.25%)	2047年3月15日	0	(2,193)
NOK	13,650,000	Receive Fixed (1.50%) - Pay Floating (3M NOK NIBOR)	2022年3月15日	0	(6,833)
				705	(206,652)

注記4 - クレジット・デフォルト・スワップ契約

2016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	1,730,000	CDX NA HY 27 500BP 5%	2021年12月20日	(106,716)
				<u>(106,716)</u>
<i>プロテクション売りポジション</i>				
USD	200,000	CDX CMBX AAA 7 50BP 0.5%	2047年1月17日	(1,171)
USD	600,000	CDX CMBX AAA 8 50BP 0.5%	2057年10月17日	(6,982)
USD	230,000	CDX NA IG 27 5Y 100BP 1%	2021年12月20日	3,470
				<u>(4,683)</u>
				<u>(111,399)</u>

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日2016年8月19日）

作成対象期間（2015年8月20日～2016年8月19日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率	純総資産額
		期騰	落中率			
10期(2012年8月20日)	円 10,181		% 0.1	% 100.7	% —	百万円 2,216
11期(2013年8月19日)	10,191		0.1	80.9	—	5,297
12期(2014年8月19日)	10,199		0.1	59.7	—	8,648
13期(2015年8月19日)	10,206		0.1	44.7	—	22,034
14期(2016年8月19日)	10,211		0.0	68.6	—	19,722

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

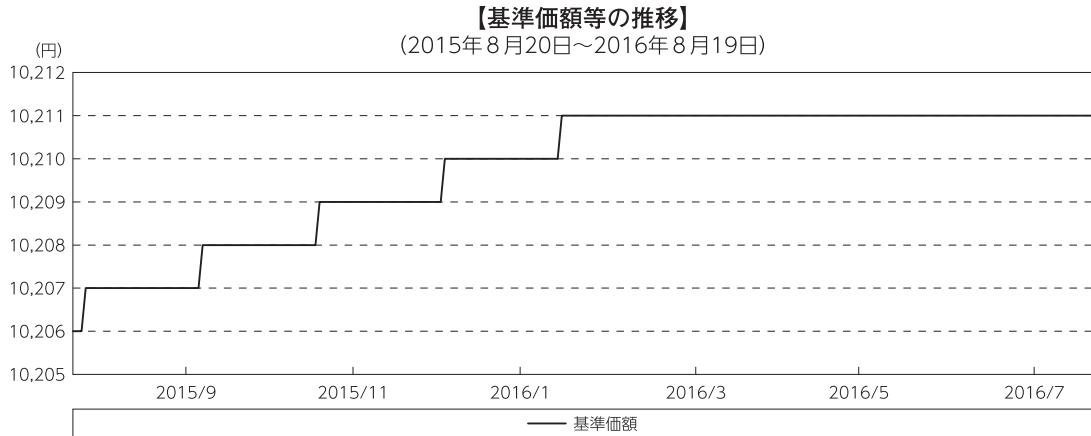
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率
		騰	落率		
(期首) 2015年8月19日	円 10,206		% —	% 44.7	% —
8月末	10,207		0.0	48.6	—
9月末	10,207		0.0	43.6	—
10月末	10,208		0.0	44.4	—
11月末	10,209		0.0	48.8	—
12月末	10,209		0.0	48.5	—
2016年1月末	10,210		0.0	51.8	—
2月末	10,211		0.0	49.1	—
3月末	10,211		0.0	40.8	—
4月末	10,211		0.0	39.9	—
5月末	10,211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

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



○基準価額の主な変動要因

投資している短期有価証券等からのインカムゲイン（利息収入）。

○投資環境

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

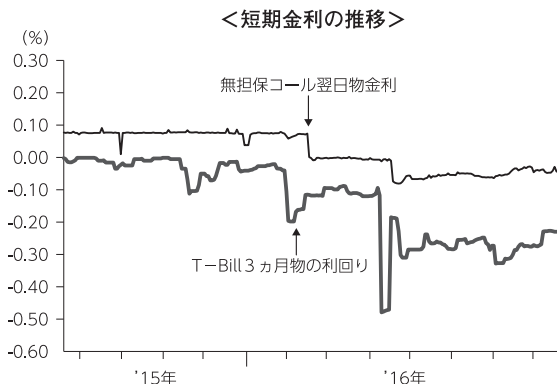
このような中、日本銀行は「量的・質的金融緩和」を継続し、2016年1月の金融政策決定会合において「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入を決定するなど、一層の金融緩和を図りました。

・無担保コール翌日物金利の推移

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

・T-Bill（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りの推移

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



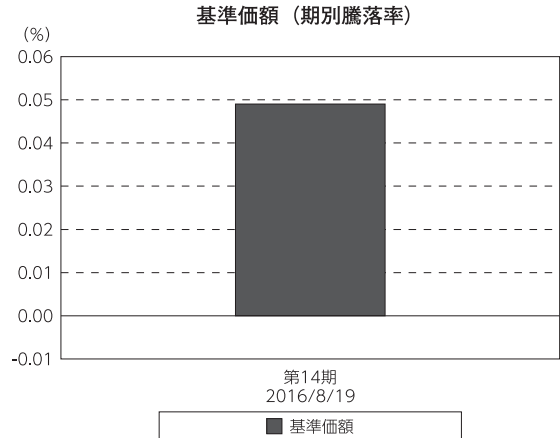
○当ファンドのポートフォリオ

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎今後の運用方針

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

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2015年8月20日～2016年8月19日)

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

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年8月20日～2016年8月19日)

公社債

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

*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

*社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

その他有価証券

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

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は償還等による増減分です。

○利害関係人との取引状況等

(2015年8月20日～2016年8月19日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	34,695	4,630	13.3	—	—	—
預金	231,734	231,734	100.0	231,734	231,734	100.0

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年8月19日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

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

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

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

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

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

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

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

国内その他有価証券

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

* 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年8月19日現在)

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

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年8月19日現在)

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

(注) 期首元本額は21,588,342,274円、期中追加設定元本額は3,803,787,310円、期中一部解約元本額は6,076,363,629円、1口当たり純資産額は1,0211円です。

○損益の状況 (2015年8月20日～2016年8月19日)

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

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

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

*損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

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

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

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

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

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

ファンド名	当期末 元本額
	円
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
ノムラ・アジア・コレクション(短期アジア現地通貨建て債券 Bコース)	98,260
第9回 野村短期公社債ファンド	98,260
第10回 野村短期公社債ファンド	98,260
野村通貨選択日本株投信(中国元コース) 年2回決算型	98,146
ノムラ THE EUROPE Aコース	98,117
ノムラ THE EUROPE Bコース	98,117
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049
ノムラ THE ASIA Aコース	97,992
グローバル・ストック Aコース	97,953
グローバル・ストック Cコース	97,953
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース) 毎月分配型	48,092
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース) 年2回決算型	13,741
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース) 年2回決算型	9,826
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型	9,826
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Aコース	9,818
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Bコース	9,818
野村日本ブランド株投資(米ドルコース) 毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース) 毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(米ドルコース) 年2回決算型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース) 年2回決算型	9,809
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	9,808
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 毎月分配型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 年2回決算型	9,808
野村米国ブランド株投資(米ドルコース) 毎月分配型	9,807
野村米国ブランド株投資(米ドルコース) 年2回決算型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	9,807
野村新米国ハイ・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

○お知らせ

該当事項はございません。

< 「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。

(2017年8月7日現在)

年 月	日
2017年8月	15、28
9月	4
10月	—
11月	1
12月	25、26

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

したがって、お申し込みにあたってはその点についても十分ご注意ください。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。