

野村グローバルボンド投信 Dコース

運用報告書(全体版)

第6期(決算日2015年3月6日) 第7期(決算日2015年4月6日) 第8期(決算日2015年5月7日)
第9期(決算日2015年6月8日) 第10期(決算日2015年7月6日) 第11期(決算日2015年8月6日)

作成対象期間(2015年2月7日~2015年8月6日)

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/資産複合	
信託期間	2014年8月11日から2024年8月6日までです。	
運用方針	円建ての外国投資信託であるノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ボンドーUSDクラス受益証券および円建ての国内籍の投資信託である野村マネー マザーファンド受益証券への投資を通じて、高利回り事業債(ハイ・イールド債)を含む世界の債券および米ドル建ての企業向け貸付債権(バンクローン)を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。 各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ボンドーUSD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 D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USD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USD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 D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/>

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			純 資 産 総 額
		税 分 配	み 金 騰 落	中 率	
(設定日)	円		円	%	百万円
2014年8月11日	10,000		—	—	2,046
1期(2014年10月6日)	10,488		10	5.0	8,843
2期(2014年11月6日)	11,062		10	5.6	11,256
3期(2014年12月8日)	11,553		10	4.5	13,773
4期(2015年1月6日)	11,521		10	△0.2	15,218
5期(2015年2月6日)	11,269		10	△2.1	15,401
6期(2015年3月6日)	11,609		10	3.1	16,086
7期(2015年4月6日)	11,546		10	△0.5	16,035
8期(2015年5月7日)	11,511		10	△0.2	15,888
9期(2015年6月8日)	12,024		10	4.5	16,380
10期(2015年7月6日)	11,865		10	△1.2	16,282
11期(2015年8月6日)	11,906		10	0.4	16,295

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 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。

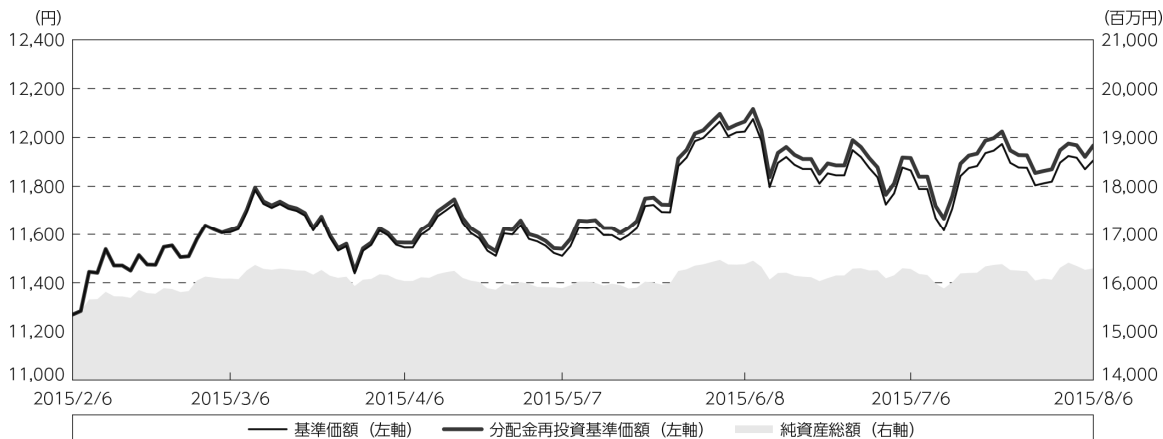
○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準	価 額	
			騰 落	率
第6期	(期 首) 2015年2月6日	円 11,269		% —
	2月末	11,509		2.1
	(期 末) 2015年3月6日	11,619		3.1
第7期	(期 首) 2015年3月6日	11,609		—
	3月末	11,556		△0.5
	(期 末) 2015年4月6日	11,556		△0.5
第8期	(期 首) 2015年4月6日	11,546		—
	4月末	11,553		0.1
	(期 末) 2015年5月7日	11,521		△0.2
第9期	(期 首) 2015年5月7日	11,511		—
	5月末	11,985		4.1
	(期 末) 2015年6月8日	12,034		4.5
第10期	(期 首) 2015年6月8日	12,024		—
	6月末	11,837		△1.6
	(期 末) 2015年7月6日	11,875		△1.2
第11期	(期 首) 2015年7月6日	11,865		—
	7月末	11,897		0.3
	(期 末) 2015年8月6日	11,916		0.4

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2015年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11,269円から当作成期末には11,906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、円/米ドルの為替変動

※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>

ECB（欧州中央銀行）が国債購入を含む追加の量的金融緩和策を開始したことや、中国人民銀行（中央銀行）が追加金融緩和を実施する姿勢を強めたことなどから、5月まで堅調に推移しました。その後は、ギリシャの債務問題に対する先行き懸念の高まりや、中国株式市場が急落したことなどを背景に、投資家のリスク回避姿勢が高まったことなどから下落する場面もありましたが、当作成期間では値上がりとなりました。

<バンクローン市場>

ECBが量的金融緩和を決定したことや、一部米国企業の決算が堅調な内容だったことに加え、ローンの供給に対しCLO（ローン担保証券）からの需要が相対的に高い状況が続いたことなどから上昇し、当作成期間では値上がりとなりました。

○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 Dコース（為替ヘッジなし 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USD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USD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USD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2.6%、AA格9.3%、A格5.4%、BBB格6.4%、BB格20.4%、B格41.7%、CCC格以下および無格付11.4%となりました。

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

[野村マネー マザーファンド]

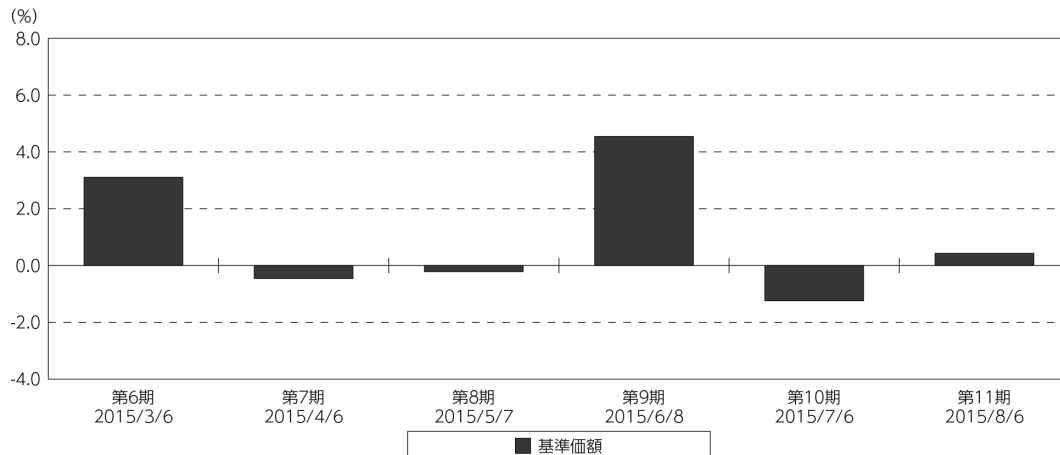
残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせてコール・ローン等で運用を行うことで流動性の確保を図りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、作成期間中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。

基準価額（期別騰落率）



(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6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期
	2015年2月7日～ 2015年3月6日	2015年3月7日～ 2015年4月6日	2015年4月7日～ 2015年5月7日	2015年5月8日～ 2015年6月8日	2015年6月9日～ 2015年7月6日	2015年7月7日～ 2015年8月6日
当期分配金	10	10	10	10	10	10
(対基準価額比率)	0.086%	0.087%	0.087%	0.083%	0.084%	0.084%
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	1,608	1,546	1,535	2,023	1,885	1,927

(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四捨五入して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 Dコース (為替ヘッジなし 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USD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USD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USD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。

[野村マネー マザーファンド]

残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資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うことで流動性の確保を図る運用を行う方針です。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願いたします。

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化の動きについて

店頭デリバティブ取引に関して、将来、国際的に規制の強化等が予定されています。ファンドが投資対象とする外国投資信託が原則として活用する店頭デリバティブ取引（オプション、NDFおよびNDO等を含みます。）が当該規制強化等の対象取引となり、かつ、当該取引を行なうための担保として現金等を提供する必要がある場合、当該現金等を資産の一部として追加的に保有することとなります。その場合、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

(2015年2月7日～2015年8月6日)

項 目	第6期～第11期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 63	% 0.536	(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)	(11)	(0.090)	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)	(50)	(0.429)	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
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	63	0.537	
作成期間の平均基準価額は、11,722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

(2015年2月7日～2015年8月6日)

投資信託証券

銘柄		第6期～第11期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド-グローバル・ボンド-ISDクラス	76,853	881,613	45,089	514,948

*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

(2015年2月7日～2015年8月6日)

利害関係人との取引状況

<野村グローバルボンド投信 D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6期～第11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 26,880	百万円 3,920	% 14.6	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

(2015年8月6日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘	柄	第5期末	第11期末		
		口数	口数	評価額	比率
		口	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-USDクラス	1,364,354	1,396,118	16,141,916	99.1
	合 計	1,364,354	1,396,118	16,141,916	99.1

*比率は、純資産総額に対する投資信託受益証券評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託残高

銘	柄	第5期末	第11期末	
		口数	口数	評価額
		千口	千口	千円
	野村マネー マザーファンド	980	980	1,000

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2015年8月6日現在)

項 目	第11期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	16,141,916	98.3
野村マネー マザーファンド	1,000	0.0
コール・ローン等、その他	275,342	1.7
投資信託財産総額	16,418,258	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6期末	第7期末	第8期末	第9期末	第10期末	第11期末
	2015年3月6日現在	2015年4月6日現在	2015年5月7日現在	2015年6月8日現在	2015年7月6日現在	2015年8月6日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	16,115,712,343	16,127,806,194	16,059,713,120	16,463,613,273	16,386,034,105	16,418,258,215
コール・ローン等	189,650,497	169,517,963	335,486,422	211,474,391	272,460,955	275,340,686
投資信託受益証券(評価額)	15,925,061,136	15,908,205,946	15,723,225,595	16,251,137,903	16,112,571,960	16,141,916,316
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,000,392	1,000,490	1,000,490	1,000,589	1,000,687	1,000,687
未収入金	—	49,081,560	—	—	—	—
未収利息	318	235	613	390	503	526
(B) 負債	29,649,062	92,215,581	170,860,626	82,660,864	103,070,529	122,882,668
未払金	1,558,152	—	56,489,958	—	—	—
未払収益分配金	13,856,877	13,887,845	13,803,402	13,623,874	13,722,963	13,686,233
未払解約金	1,142,569	63,482,141	85,852,529	53,747,628	75,895,044	94,302,928
未払信託報酬	13,065,341	14,815,973	14,685,376	15,258,854	13,425,681	14,863,790
その他未払費用	26,123	29,622	29,361	30,508	26,841	29,717
(C) 純資産総額(A-B)	16,086,063,281	16,035,590,613	15,888,852,494	16,380,952,409	16,282,963,576	16,295,375,547
元本	13,856,877,998	13,887,845,401	13,803,402,101	13,623,874,990	13,722,963,612	13,686,233,965
次期繰越損益金	2,229,185,283	2,147,745,212	2,085,450,393	2,757,077,419	2,559,999,964	2,609,141,582
(D) 受益権総口数	13,856,877,998口	13,887,845,401口	13,803,402,101口	13,623,874,990口	13,722,963,612口	13,686,233,965口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,609円	11,546円	11,511円	12,024円	11,865円	11,906円

(注) 第6期首元本額13,666百万円、第6～第11期中追加設定元本額1,807百万円、第6～第11期中一部解約元本額1,787百万円、第11期末計算口数当たり純資産額11,906円。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額1,595,214円。

○損益の状況

項 目	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期
	2015年2月7日～ 2015年3月6日	2015年3月7日～ 2015年4月6日	2015年4月7日～ 2015年5月7日	2015年5月8日～ 2015年6月8日	2015年6月9日～ 2015年7月6日	2015年7月7日～ 2015年8月6日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	82,105,266	83,041,664	82,649,416	82,186,646	81,966,817	82,125,556
受取配当金	82,091,996	83,029,199	82,636,874	82,173,559	81,954,918	82,110,540
受取利息	13,270	12,465	12,542	13,087	11,899	15,016
(B) 有価証券売買損益	408,067,851	△ 142,205,176	△ 105,551,532	639,664,650	△ 268,088,181	1,275,292
売買益	410,747,012	1,141,799	492,592	646,732,145	4,075,131	2,386,713
売買損	△ 2,679,161	△ 143,346,975	△ 106,044,124	△ 7,067,495	△ 272,163,312	△ 1,111,421
(C) 信託報酬等	△ 13,091,464	△ 14,845,595	△ 14,714,737	△ 15,289,362	△ 13,452,522	△ 14,893,507
(D) 当期繰越損益(A+B+C)	477,081,653	△ 74,009,107	△ 37,616,853	706,561,934	△ 199,573,886	68,507,341
(E) 前期繰越損益金	976,927,829	1,415,100,271	1,297,581,325	1,215,211,340	1,873,375,714	1,606,253,916
(F) 追加信託差損益金	789,032,678	820,541,893	839,289,323	848,928,019	899,921,099	948,066,558
(配当等相当額)	(538,288,526)	(569,737,178)	(592,630,204)	(604,656,486)	(659,881,441)	(718,585,934)
(売買損益相当額)	(250,744,152)	(250,804,715)	(246,659,119)	(244,271,533)	(240,039,658)	(229,480,624)
(G) 計(D+E+F)	2,243,042,160	2,161,633,057	2,099,253,795	2,770,701,293	2,573,722,927	2,622,827,815
(H) 収益分配金	△ 13,856,877	△ 13,887,845	△ 13,803,402	△ 13,623,874	△ 13,722,963	△ 13,686,233
次期繰越損益金(G+H)	2,229,185,283	2,147,745,212	2,085,450,393	2,757,077,419	2,559,999,964	2,609,141,582
追加信託差損益金	789,032,678	820,541,893	839,289,323	848,928,019	899,921,099	948,066,558
(配当等相当額)	(538,288,531)	(569,737,183)	(592,630,207)	(604,656,489)	(659,881,452)	(718,585,945)
(売買損益相当額)	(250,744,147)	(250,804,710)	(246,659,116)	(244,271,530)	(240,039,647)	(229,480,613)
分配準備積立金	1,478,438,935	1,507,007,331	1,527,364,719	1,908,149,400	1,928,167,467	1,919,175,254
繰越損益金	△ 38,286,330	△ 179,804,012	△ 281,203,649	-	△ 268,088,602	△ 258,100,230

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

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

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

(注) 分配金の計算過程(2015年2月7日～2015年8月6日)は以下の通りです。

項 目	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期
	2015年2月7日～ 2015年3月6日	2015年3月7日～ 2015年4月6日	2015年4月7日～ 2015年5月7日	2015年5月8日～ 2015年6月8日	2015年6月9日～ 2015年7月6日	2015年7月7日～ 2015年8月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	79,912,651円	68,196,295円	67,934,868円	80,445,521円	68,514,716円	67,460,277円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円	0円	0円	352,127,855円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	750,746,348円	640,737,881円	592,630,207円	848,928,019円	659,881,452円	718,585,945円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	1,412,383,161円	1,452,698,881円	1,473,233,253円	1,489,199,898円	1,873,375,714円	1,865,401,210円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	2,243,042,160円	2,161,633,057円	2,133,798,328円	2,770,701,293円	2,601,771,882円	2,651,447,432円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	1,618円	1,556円	1,545円	2,033円	1,895円	1,937円
g. 分配金	13,856,877円	13,887,845円	13,803,402円	13,623,874円	13,722,963円	13,686,233円
h. 分配金(1万円当たり)	10円	10円	10円	10円	10円	10円

○分配金のお知らせ

	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11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

運用の外部委託先である野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社（NFR&T）は、平成27年10月1日（予定）をもって、リテール運用関連事業を野村アセットマネジメント株式会社に承継します。これに伴い、同日以降は運用の外部委託を行わず、NFR&Tは投資信託証券の評価等をし、運用に関する助言を行い、それに基づき、野村アセットマネジメント株式会社が運用を行います。また、組織再編に関し、ファンドの投資方針には何ら変更はありません。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2015年8月6日現在)

＜野村マネー マザーファンド＞

下記は、野村マネー マザーファンド全体(21,606,221千円)の内容です。

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	第11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	%	%	%	%	%
国債証券	2,020,000 (1,910,000)	2,020,007 (1,909,991)	9.2 (8.7)	— (—)	— (—)	— (—)	9.2 (8.7)
地方債証券	1,201,600 (1,201,600)	1,206,976 (1,206,976)	5.5 (5.5)	— (—)	— (—)	— (—)	5.5 (5.5)
特殊債券 (除く金融債)	4,776,000 (4,776,000)	4,795,030 (4,795,030)	21.7 (21.7)	— (—)	— (—)	— (—)	21.7 (21.7)
金融債券	1,370,000 (1,370,000)	1,373,267 (1,373,267)	6.2 (6.2)	— (—)	— (—)	— (—)	6.2 (6.2)
普通社債券 (含む投資法人債券)	1,200,000 (1,200,000)	1,207,492 (1,207,492)	5.5 (5.5)	— (—)	— (—)	— (—)	5.5 (5.5)
合 計	10,567,600 (10,457,600)	10,602,773 (10,492,757)	48.1 (47.6)	— (—)	— (—)	— (—)	48.1 (47.6)

* ()内は非上場債で内書きです。

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

*金額の単位未満は切り捨て。

*—印は組み入れなし。

*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	柄	第11期末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫短期証券	第530回	—	380,000	379,996	2015/8/10
国庫短期証券	第532回※	—	400,000	399,996	—
国庫短期証券	第541回	—	500,000	499,999	2015/9/28
国庫短期証券	第542回	—	200,000	199,999	2015/10/5
国庫短期証券	第546回	—	100,000	99,999	2015/10/19
国庫短期証券	第547回	—	300,000	299,999	2015/10/26
国庫短期証券	第548回	—	30,000	29,999	2015/11/2
国庫債券	利付(2年)第331回	0.1	60,000	60,005	2015/8/15
国庫債券	利付(2年)第333回	0.1	50,000	50,010	2015/10/15
小	計		2,020,000	2,020,007	
地方債証券					
東京都	公募第625回	1.41	200,000	200,308	2015/9/18
北海道	公募平成17年度第6回	1.4	105,100	105,188	2015/8/31
北海道	公募平成17年度第12回	1.6	50,000	50,390	2016/2/24
神奈川県	公募第136回	1.5	90,000	90,462	2015/12/28
大阪府	公募第284回	1.6	300,000	301,361	2015/11/27
新潟県	公募平成18年度第1回	2.1	6,500	6,621	2016/7/27
共同発行市場地方債	公募第31回	1.5	50,000	50,147	2015/10/23
共同発行市場地方債	公募第32回	1.6	100,000	100,442	2015/11/25
共同発行市場地方債	公募第34回	1.4	200,000	201,221	2016/1/25
共同発行市場地方債	公募第35回	1.6	100,000	100,831	2016/2/25
小	計		1,201,600	1,206,976	
特殊債券(除く金融債)					
日本高速道路保有・債務返済機構承継	政府保証第346回	1.4	300,000	300,235	2015/8/26
日本高速道路保有・債務返済機構承継	政府保証第347回	1.3	352,000	352,563	2015/9/22
首都高速道路債券	政府保証第199回	1.4	50,000	50,041	2015/8/28
阪神高速道路債券	政府保証第148回	1.3	20,000	20,036	2015/9/30
本州四国連絡橋債券	政府保証第27回	1.4	300,000	300,282	2015/8/31
公営企業債券	政府保証第854回	1.4	60,000	60,026	2015/8/18
公営企業債券	政府保証第861回	1.6	29,000	29,272	2016/3/17
公営企業債券	政府保証第862回	1.8	117,000	118,407	2016/4/20
日本政策金融公庫債券	政府保証第3回	0.8	30,000	30,005	2015/8/14
日本高速道路保有・債務返済機構承継	政府保証債第1回	1.5	100,000	100,550	2015/12/25
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第3回	1.5	590,000	593,993	2016/1/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第5回	1.6	558,000	562,756	2016/2/26
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第11回	1.8	170,000	172,097	2016/4/26
首都高速道路債券	政府保証第1回	1.6	400,000	403,944	2016/3/28
中部国際空港債券	政府保証第17回	0.051	300,000	300,000	2016/3/7
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第119回	0.067	200,000	199,992	2015/12/18
地方公共団体金融機構債券	2年第1回	0.135	200,000	200,060	2016/2/26
首都高速道路社債	第6回	0.315	100,000	100,032	2015/9/24
阪神高速道路社債	財投機関債第6回	0.589	100,000	100,184	2015/12/18
中日本高速道路債券	財投機関債第20回	0.417	100,000	100,036	2015/9/18
中日本高速道路社債	財投機関債第37回	0.385	200,000	200,335	2016/2/26
西日本高速道路	第16回	0.246	200,000	200,048	2015/9/18
西日本高速道路	第17回	0.196	300,000	300,125	2015/12/18
小	計		4,776,000	4,795,030	

銘	柄	第11期末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
金融債券		%	千円	千円	
商工債券	利付第724回い号	0.5	320,000	320,181	2015/9/25
商工債券	利付第733回い号	0.55	300,000	301,234	2016/6/27
商工債券	利付第734回い号	0.55	150,000	150,680	2016/7/27
農林債券	利付第723回い号	0.55	150,000	150,043	2015/8/27
農林債券	利付第724回い号	0.5	50,000	50,028	2015/9/25
商工債券	利付(3年)第152回	0.2	100,000	100,017	2015/9/25
商工債券	利付(3年)第153回	0.2	100,000	100,030	2015/10/27
商工債券	利付(3年)第161回	0.25	100,000	100,150	2016/6/27
商工債券	利付(10年)第2回	1.78	100,000	100,901	2016/2/19
小	計		1,370,000	1,373,267	
普通社債券(含む投資法人債券)					
みずほコーポレート銀行	第24回特定社債間限定同順位特約付	0.595	200,000	200,450	2016/1/20
みずほコーポレート銀行	第25回特定社債間限定同順位特約付	0.755	100,000	100,451	2016/4/20
トヨタファイナンス	第19回社債間限定同等特約付	2.04	200,000	202,352	2016/3/18
三菱UFJリース	第13回社債間限定同順位特約付	0.796	500,000	502,457	2016/4/22
三菱UFJリース	第22回社債間限定同順位特約付	0.235	100,000	100,070	2016/2/26
東邦瓦斯	第30回社債間限定同順位特約付	2.07	100,000	101,709	2016/6/20
小	計		1,200,000	1,207,492	
合	計		10,567,600	10,602,773	

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

**印は現先で保有している債券です。

国内その他有価証券

区 分	第11期末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 2,399,166	% 10.9

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

* 金額の単位未満は切り捨て。

Nomura Multi Managers Fund – Global Bond

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ボンド

2014年12月31日決算

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

形 態	ケイマン諸島籍円建て外国投資信託	
主 要 投 資 対 象	◆高利回り事業債(ハイ・イールド債)を含む世界の債券および米ドル建ての企業向け貸付債権(バンクローン)	
投 資 方 針	●ハイ・イールド債 ^{*1} を含む世界の債券および米ドル建てのバンクローン ^{*2} を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。 ※1ハイ・イールド債とは、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。 ※2バンクローンとは、事業会社等が事業の拡大等に必要資金を調達するために、銀行等の金融機関等から借入れるローンをいいます。	
	●投資にあたっては、3つの投資戦略(「ハイ・イールド債戦略」、「バンクローン戦略」、「ストラテジック・インカム/トータル・リターン戦略」)に配分します。なお、1投資戦略あたりの配分比率は、原則として、純資産総額の25%以上50%以内に維持することを基本とします。	
	投資戦略	主な投資方針
	ハイ・イールド債戦略	世界のハイ・イールド債を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。
	バンクローン戦略	米ドル建てのバンクローンを主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。
ストラテジック・インカム/トータル・リターン戦略	ハイ・イールド債を含む世界の債券を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインとキャピタルゲインの獲得によるトータル・リターンの追求を目指します。	
	●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、債券等と比べ返済順位が高く、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。 ●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買いの為替取引を行いません。 ●USDクラスについては、対円で為替ヘッジを行いません。 ●CRSクラスについては、実質的な通貨配分にかかわらず、原則として純資産総額を米ドル換算した額とほぼ同額程度の米ドルを売り、米ドル以外の選定通貨を買う為替取引を行いません。 ●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なう副投資顧問会社の選定と、各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率を決定します。 ●副投資顧問会社の選定にあたっては、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、各投資戦略の運用において優れていると判断した運用会社を選定します。 ●投資顧問会社は選定した副投資顧問会社およびファンド全体のリスク特性の状況を絶えずモニターし、必要に応じて各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率の変更や副投資顧問会社の人替を適宜行ないます。	
	<CRSクラスにおける通貨運用方針> ●原則として、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ブロードおよびJP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・ブロード構成国の通貨の中から、金利水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、相対的に金利が高い5つの通貨を選定することを基本とします。選定通貨は定期的に(原則、毎月)見直すこととします。 ●1通貨当りのエクスポージャーについては、原則として、純資産総額の10%~30%程度の範囲内に維持することを基本とします。 ●ファンダメンタルズおよび流動性を考慮して、選択される通貨が4以下または6以上となる場合があります。この場合、1通貨当りのエクスポージャーは上記の範囲を超える場合があります。	
受 託 会 社	グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー	
投 資 顧 問 会 社	野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社*	
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・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。

*NFR&TIは、平成27年10月1日(予定)にリテール運用関連事業を分割し、野村アセットマネジメント株式会社が当該事業を承継します。これに伴い、同日以降は、ファンドの投資顧問会社は野村アセットマネジメント株式会社となります。

「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(「カストディアン・ルール」)に基づき、保管銀行から受益者または受益者のために投資顧問会社が任命した「独立した代理人」に対し、米国法で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
2014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		395,231,449
(取得原価: 400,614,340米ドル)		
現金預金等		56,961,426
未実現クレジット・デフォルト・スワップ評価益		531,611
先物取引契約に係る委託証拠金		1,957,752
金利スワップ契約未収利息		15
受益証券発行未収金		6,805,137
ブローカーからの受取金		1,401,375
未収収益		3,776,670
設立費用		35,500
		<hr/>
資産合計		466,700,935
		<hr/>
負債		
銀行借越金		6,984,647
金利スワップ契約に係る未実現損		1,809,693
先物契約に係る未実現損		351,494
外国為替先渡し契約に係る評価差損		4,818,977
ブローカーへの未払金		28,512,888
未払費用		1,200,158
未払利子		15
		<hr/>
負債合計		43,677,872
		<hr/>
純資産総額		423,023,063
		<hr/> <hr/>

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)	9,694	145,280	1,408,343,284
通貨セレクトクラス(円)	10,002	2,160,384	21,608,194,312
米ドルクラス(円)	11,375	2,420,356	27,530,491,534

運用計算書
2014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	7,311
債券利息	4,078,242
金利スワップ取引契約に係る受取利息	2,870
受取配当金等	186,530
雑収益	2,735
収益合計	4,277,688
費用	
投資顧問及び共同投資顧問報酬	922,828
事務管理代行報酬	115,805
保管費用	34,767
金利スワップ取引契約に係る支払利息	2,854
当座借越利息	560
取引銀行報酬	16,305
銀行手数料	142,560
受託報酬	23,177
法務報酬	26,309
海外登記手数料	561
立替費用	19,932
専門家報酬	83,649
設定費用償却	5,500
雑費用	200
費用合計	1,395,007
純投資損益	2,882,681
投資有価証券売買に係る損益	22,271
先物取引契約に係る損益	(658,066)
オプション契約に係る損益	32,690
外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益	(7,129,416)
金利スワップ取引契約に係る損益	934,821
クレジット・デフォルト・スワップ契約に係る損益	(548,266)
当期実現純損益	(7,345,966)
投資有価証券評価損益の増減	(5,382,891)
先物取引契約に係る評価損益の増減	(351,494)
金利スワップ取引契約に係る評価損益の増減	(1,809,693)
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	531,611
外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減	(4,818,977)
当期評価差損益	(11,831,444)
運用の結果による純資産の増減額	(16,294,729)

純資産変動計算書
2014年12月31日に終了する計測期間
(金額は米ドル表示)

期初純資産総額	-----	--
純投資損益		2,882,681
当期実現純損益		(7,345,966)
当期評価差損益	-----	(11,831,444)
運用の結果による純資産の増減額	-----	(16,294,729)
受益証券の発行手取金		453,576,831
受益証券の買戻支払金	-----	(424,698)
	-----	453,152,133
受益者への支払分配金	-----	(13,834,341)
期末純資産総額	-----	423,023,063

発行済受益証券数の変動表
2014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	--
発行受益証券数	150,504
買戻受益証券数	(5,224)
	<hr/>
期末現在発行済受益証券数	145,280
	<hr/>
通貨セレクトクラス	
期首受益証券数	--
発行受益証券数	2,160,384
買戻受益証券数	0
	<hr/>
期末現在発行済受益証券数	2,160,384
	<hr/>
米ドルクラス	
期首受益証券数	--
発行受益証券数	2,420,356
買戻受益証券数	0
	<hr/>
期末現在発行済受益証券数	2,420,356
	<hr/> <hr/>

統計情報
2014年12月31日現在
(未監査)

	2014
期末純資産総額(米ドル)	423,023,063
日本円クラス(円)	
期末純資産総額	1,408,343,284
期末1口当たり純資産価格	9,694
通貨セレクトクラス(円)	
期末純資産総額	21,608,194,312
期末1口当たり純資産価格	10,002
米ドルクラス(円)	
期末純資産総額	27,530,491,534
期末1口当たり純資産価格	11,375

組入資産明細
2014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	720,330	0.17
USD	650,000	ANZ FRN 08/08/22 EMTN	670,962	673,871	0.16
			1,392,979	1,394,201	0.33
国債					
AUD	1,300,000	AUSTRALIAN GVT 2.75% 21/04/24 137	1,076,341	1,060,120	0.25
			1,076,341	1,060,120	0.25
その他債券					
USD	139,000	FMG RES AUG06 6.875% 01/02/18 144A	64,712	56,259	0.01
			64,712	56,259	0.01
普通社債(固定金利債)					
USD	225,000	FMG RES AUG 06 8.25% 01/11/19 144A	198,938	205,853	0.05
			198,938	205,853	0.05
		合計: オーストラリア	2,732,970	2,716,433	0.64
ベルギー					
国債					
EUR	1,400,000	KINGDOM OF BELGIUM 3% 28/09/19 67	2,020,299	1,934,318	0.45
EUR	1,305,000	BELGIUM KINGDOM 2.6% 22/06/24 72	1,862,486	1,843,402	0.44
			3,882,785	3,777,720	0.89
		合計: ベルギー	3,882,785	3,777,720	0.89
バミューダ諸島					
普通社債(固定金利債)					
USD	500,000	AIRCASTLE LTD 5.125% 15/03/21	510,625	500,953	0.13
USD	295,000	NCL CORP 5% 15/02/18	299,125	295,201	0.07
USD	200,000	DIGICEL GP LTD 7.125% 01/04/22 144A	200,250	189,545	0.04
USD	145,000	NCL CORP 5.25% 15/11/19 144A	145,000	146,270	0.03
			1,155,000	1,131,969	0.27
		合計: バミューダ諸島	1,155,000	1,131,969	0.27
ブラジル					
その他債券					
USD	200,000	BRAZIL MINAS 5.333% 15/02/28 REGS	204,500	197,425	0.05
			204,500	197,425	0.05
普通社債(固定金利債)					
USD	100,000	VALE SA 5.625% 11/09/42	100,659	93,322	0.02
			100,659	93,322	0.02
		合計: ブラジル	305,159	290,747	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 (%)
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	663,121	0.15
USD	650,000	CNOOC 3.875% 02/05/22 REGS	657,497	659,984	0.16
USD	483,000	STUDIO CITY FIN 8.5% 01/12/20 144A	533,111	506,541	0.12
			<u>1,853,208</u>	<u>1,829,646</u>	<u>0.43</u>
		合計: 英領ヴァージン諸島	<u>1,853,208</u>	<u>1,829,646</u>	<u>0.43</u>
カナダ					
普通社債(固定金利債)					
USD	635,000	VPII ESCROW CORP 7.5% 15/07/21 144A	693,349	686,617	0.17
USD	600,000	BOMBARDIER INC 6% 15/10/22 144A	616,124	607,128	0.14
USD	440,000	BARRICK GOLD CORP 4.1% 01/05/23	427,650	426,969	0.10
USD	325,000	BKW 6% 01/04/22 144A	325,188	333,697	0.08
USD	300,000	ULTRA PETROLEUM 5.75% 15/12/18 144A	303,000	276,275	0.07
USD	250,000	VPII ESCROW CORP 6.75% 15/8/18 144a	267,188	265,138	0.06
USD	217,000	AINSWORTH LUMBER 7.5% 15/12/17 144A	225,737	224,134	0.05
USD	175,000	NORTEL NETWORKS 10.75% 15/07/16	204,125	197,379	0.05
USD	150,000	KODIAK OIL&GAS 8.125% 01/12/19 WI	161,802	153,460	0.04
USD	150,000	FIRST QUANTUM MIN 7% 15/02/21 144A	147,188	134,463	0.03
USD	100,000	VALEANT PHARMA 5.625% 01/12/21 144A	98,625	100,919	0.02
USD	100,000	KISSNER MILLING CO 7.25% 01/06/19 1	103,500	100,109	0.02
USD	90,000	BOMBARDIER INC 7.75% 15/03/20 144A	97,875	97,781	0.02
USD	93,000	NOVELIS INC 8.375% 15/12/17	97,301	96,523	0.02
USD	78,000	EVRAZ INC NA CANADA 7.5% 15/11/19 1	78,000	75,562	0.02
USD	75,000	MEG ENERGY CORP 7% 31/03/24 144A	67,750	67,649	0.02
USD	50,000	MEG ENERGY CORP 6.5% 15/03/21 144A	43,875	45,074	0.01
USD	25,000	LUNDIN MINING 7.875% 1/11/22 144A	25,000	25,139	0.01
USD	25,000	LUNDIN MINING 7.5% 1/11/20 144A	25,000	24,787	0.01
USD	25,000	THOMPSON CREEK MET 7.375% 01/06/18	25,094	20,580	0.00
			<u>4,033,371</u>	<u>3,959,383</u>	<u>0.94</u>
		合計: カナダ	<u>4,033,371</u>	<u>3,959,383</u>	<u>0.94</u>
ケイマン諸島					
普通社債(固定金利債)					
USD	650,000	MIZUHO FIN GP CAY 4.2% 18/7/22 REGS	680,982	677,957	0.15
USD	315,000	TRANSOCEAN INC 3.8% 15/10/22	296,445	254,523	0.06
USD	200,000	SEAGATE HDD CAY 4.75% 01/06/23	201,250	207,717	0.05
USD	200,000	NEXTEER AUTO 5.875% 15/11/21 144A	200,000	198,858	0.05
USD	200,000	ALIBABA GP HDGS 2.5% 28/11/19 REGS	199,236	196,472	0.05
USD	50,000	TRANSOCEAN INC 6.8% 15/03/38	54,019	43,355	0.01
			<u>1,631,932</u>	<u>1,578,882</u>	<u>0.37</u>
		合計: ケイマン諸島	<u>1,631,932</u>	<u>1,578,882</u>	<u>0.37</u>
コロンビア					
普通社債(固定金利債)					
USD	100,000	ECOPETROL SA 5.875% 28/05/45	106,650	93,015	0.02
			<u>106,650</u>	<u>93,015</u>	<u>0.02</u>
		合計: コロンビア	<u>106,650</u>	<u>93,015</u>	<u>0.02</u>
コスタリカ					
普通社債(固定金利債)					
USD	200,000	BANCO NAL COSTA 6.25% 1/11/23 REGS	207,180	199,484	0.05
			<u>207,180</u>	<u>199,484</u>	<u>0.05</u>
		合計: コスタリカ	<u>207,180</u>	<u>199,484</u>	<u>0.05</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 (%)
ドミニカ共和国					
国債					
USD	100,000	DOMINICAN REP 7.45% 30/04/44 144A	111,440	109,656	0.03
			111,440	109,656	0.03
		合計: ドミニカ共和国	111,440	109,656	0.03
フランス					
変動金利債					
EUR	600,000	GDF EDF FRN 10/07/49	846,664	816,962	0.19
EUR	600,000	EDF FRN 31/12/49	819,796	785,916	0.19
USD	300,000	EDF FRN 29/12/49 144A	315,000	315,780	0.07
GBP	100,000	CREDIT AGRICOLE SA FRN 29/06/49	165,037	157,555	0.04
USD	120,000	SOCIETE GENERALE FRN 31/12/49 144A	114,132	109,500	0.03
			2,260,629	2,185,713	0.52
国債					
EUR	1,100,000	FRANCE OAT 1.75% 25/11/24	1,457,626	1,457,335	0.34
			1,457,626	1,457,335	0.34
普通社債(固定金利債)					
EUR	600,000	BANQUE FED CRED 2.625% 18/03/24 EMT	830,295	826,002	0.19
USD	800,000	NUMERICABLE GRP 6% 15/05/22 144A	783,375	806,840	0.19
EUR	600,000	BPCE 2.125% 17/03/21 EMTN	805,714	788,920	0.19
USD	500,000	EDF 6.95% 26/01/39	671,500	679,885	0.16
USD	600,000	BNP PARIBAS 4.25% 15/10/24	601,250	608,388	0.14
EUR	300,000	BNP PARIBAS 2.375% 20/05/24 EMTN	406,397	406,998	0.10
USD	400,000	NUMERICABLE GRP 4.875% 15/05/19 144	403,000	395,652	0.09
			4,501,531	4,512,685	1.06
		合計: フランス	8,219,786	8,155,733	1.92
ドイツ					
変動金利債					
EUR	700,000	ALLIANZ SE FRN 29/09/49	879,224	858,932	0.20
USD	200,000	DEUTSCHE BANK FRN 29/12/49	200,130	194,660	0.05
			1,079,354	1,053,592	0.25
国債					
EUR	585,000	BUNDESREP DEUTSCHLAND 2.5% 15/8/46	853,816	915,124	0.22
EUR	500,000	BUNDESREP DEUTSCHLAND 2% 15/08/23	696,790	692,204	0.16
			1,550,606	1,607,328	0.38
ステップアップ/ダウン債					
EUR	100,000	MERCK KGAA FRN 12/12/74	122,920	126,156	0.03
			122,920	126,156	0.03
普通社債(固定金利債)					
USD	600,000	UNITYMEDIA KABEL 6.125% 15/01/25 14	601,250	620,931	0.15
USD	550,000	UNITYMEDIA KABEL 5% 15/01/25 144A	546,000	552,741	0.13
			1,147,250	1,173,672	0.28
		合計: ドイツ	3,900,130	3,960,748	0.94
ガーンジー島					
変動金利債					
USD	400,000	CREDIT SUISSE GUERNSEY FRN 11/12/49	430,500	417,476	0.10
			430,500	417,476	0.10
		合計: ガーンジー島	430,500	417,476	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 (%)
香港					
普通社債(固定金利債)					
USD	650,000	BANK OF CHINA HK 3.125% 23/01/19 EM	659,760	656,159	0.16
			659,760	656,159	0.16
		合計: 香港	659,760	656,159	0.16
アイルランド					
変動金利債					
USD	200,000	ARDAGH PKG FIN FRN 15/12/19 144A	199,750	195,000	0.05
			199,750	195,000	0.05
国債					
EUR	700,000	IRISH GVT 2.4% 15/05/30	866,821	919,279	0.21
			866,821	919,279	0.21
普通社債(固定金利債)					
USD	700,000	GRIFOLS WORLDWIDE 5.25% 1/04/22 144	710,750	717,186	0.17
EUR	125,000	ARDAGH PACK 9.25% 15/10/20 REGS	176,859	160,423	0.04
			887,609	877,609	0.21
		合計: アイルランド	1,954,180	1,991,888	0.47
イタリア					
国債					
EUR	450,000	BTPS 5.5% 01/11/22	714,374	701,243	0.16
EUR	370,000	BTPS 2.35% 15/09/19 CPI	568,893	539,561	0.13
EUR	280,000	BTPS 4.5% 01/02/18	392,682	379,634	0.09
EUR	245,000	BTPS 4.5% 01/03/26	379,848	366,540	0.09
EUR	230,000	BTPS 2.55% 15/09/41 CPI	343,461	338,965	0.08
EUR	240,000	BTPS 3.75% 01/09/24	338,354	338,779	0.08
EUR	200,000	BTPS 4.75% 01/09/21	308,432	295,070	0.07
EUR	200,000	BTPS 4% 01/02/37	272,185	279,920	0.07
EUR	180,000	BTPS 2.5% 01/12/24	227,093	229,670	0.05
EUR	130,000	BTPS 4.5% 01/05/23	193,381	191,827	0.05
EUR	150,000	REP OF ITALY 1.15% 15/05/17	197,656	184,656	0.04
EUR	100,000	BTPS 5% 01/09/40	161,026	160,016	0.04
			4,097,385	4,005,881	0.95
		合計: イタリア	4,097,385	4,005,881	0.95
ルクセンブルグ					
ペイ・イン・カインド(PIK)債					
USD	782,882	ARDAGH FIN PIK 8.625% 15/06/19 144A	763,125	777,843	0.18
USD	25,000	CAPSUGEL SA PIK 7% 15/05/19 144A	25,438	25,025	0.01
			788,563	802,868	0.19
ステップアップ/ダウン債					
USD	625,000	ARCELORMITTAL 7% 15/10/39	663,244	643,660	0.15
USD	150,000	ARCELOR MITTAL 5.5% 01/03/21	151,500	155,322	0.04
USD	25,000	ARCELORMITTAL STUP 01/06/19	31,281	30,124	0.01
			846,025	829,106	0.20
普通社債(固定金利債)					
USD	1,500,000	INTELSAT LUX 8.125% 01/06/23	1,616,249	1,525,378	0.35
USD	1,000,000	WIND ACQUIS FIN 7.375% 23/04/21 144	989,000	947,779	0.22
USD	610,000	MALLINCKRODT INTL 4.75% 15/04/23	574,100	586,914	0.14
USD	480,000	INTEL JACKSON 7.25% 01/04/19	505,918	500,737	0.12
USD	325,000	MALLINCKRODT FIN 5.75% 1/8/22 144A	328,563	336,179	0.08

通貨	数量/ 額面価格 ⁽¹⁾	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
USD	230,000	TELECOM ITALIA CAP 6.999% 04/06/18	256,910	254,330	0.06
USD	230,000	ALTICE SA 7.75% 15/05/22 144A	243,934	230,727	0.05
USD	200,000	ARCELORMITTAL 5.75% 05/08/20	213,640	206,316	0.05
USD	200,000	CONSOLID NRG 6.75% 15/10/19 144	198,000	195,750	0.05
CHF	150,000	AGUILA 3 SA 7.875% 31/01/18 REG2	154,998	148,808	0.04
USD	100,000	BEVERAGE PACK 5.625% 15/12/16 144A	101,750	98,289	0.02
USD	125,000	NII INTL TELECOM 11.375% 15/8/19 14	93,875	90,104	0.02
USD	70,000	INTELSAT JACKSON 7.5% 01/04/21	74,550	74,953	0.02
USD	75,000	NII INTL TELECOM 7.875% 15/8/19 144	57,281	53,692	0.01
USD	50,000	INTELSAT JACK 7.25% 15/10/20 GDT	52,650	52,790	0.01
			<u>5,461,418</u>	<u>5,302,746</u>	<u>1.24</u>
		合計: ルクセンブルグ	<u>7,096,006</u>	<u>6,934,720</u>	<u>1.63</u>
		マーシャル諸島			
普通社債(固定金利債)					
USD	50,000	NAVIOS MARITIME 8.125% 15/11/21 144	51,500	49,582	0.01
			<u>51,500</u>	<u>49,582</u>	<u>0.01</u>
		合計: マーシャル諸島	<u>51,500</u>	<u>49,582</u>	<u>0.01</u>
		メキシコ			
国債					
MXN	107,150	MEXICAN BONOS DES 7.75% 13/11/42 M	888,265	833,382	0.20
MXN	100,000	MEXICAN BONOS DES 6.5% 9/06/22 M	761,944	710,461	0.17
MXN	90,000	MEXICAN BONOS DES 4.75% 14/06/18 M	664,958	608,509	0.14
MXN	60,000	MEXICAN BONOS DES 8.5% 31/5/29 M	533,837	492,364	0.12
			<u>2,849,004</u>	<u>2,644,716</u>	<u>0.63</u>
普通社債(固定金利債)					
USD	200,000	TRUST F/1401 5.25% 15/12/24 REGS	213,600	207,984	0.05
USD	200,000	CEMEX SAB DE CV 5.7% 11/1/25 144A	200,000	192,530	0.05
USD	200,000	MEXICHEM SAB DE 5.875% 17/09/44 144	198,300	189,466	0.04
USD	100,000	GRUPO BIMBO SAB 4.875% 27/06/44 144	99,650	100,438	0.02
			<u>711,550</u>	<u>690,418</u>	<u>0.16</u>
短期国庫債券					
MXN	1,264,250	MEXICAN CETES 0% 05/03/15 BI	937,683	852,122	0.21
MXN	1,077,237	MEXICAN CETES 0% 19/03/15 BI	732,323	725,211	0.17
MXN	595,139	MEXICAN CETES 0% 19/02/15 BI	415,175	401,584	0.09
MXN	304,366	MEXICAN GVT 0% 31/12/14 BI	224,824	206,137	0.05
MXN	264,014	MEXICAN CETES 0% 01/04/15 BI	178,174	177,540	0.04
MXN	232,079	MEXICAN CETES 0% 05/02/15 BI	156,592	156,752	0.04
MXN	199,294	MEXICAN T-BILLS 0% 29/01/15 BI	146,016	134,692	0.03
MXN	183,571	MEXICAN CETES 0% 12/03/15 BI	123,668	123,638	0.03
MXN	86,897	MEXICAN CETES 0% 26/03/15 BI	58,717	58,443	0.01
			<u>2,973,172</u>	<u>2,836,119</u>	<u>0.67</u>
		合計: メキシコ	<u>6,533,726</u>	<u>6,171,253</u>	<u>1.46</u>
		オランダ			
変動金利債					
USD	600,000	ABN AMRO BK 6.25% 13/09/22 EMTN	655,861	649,750	0.16
USD	350,000	ING BANK NV FRN 21/11/23 EMTN	356,761	356,922	0.08
USD	200,000	KONINKLIJKE KPN FRN 28/03/73 144A	208,000	210,100	0.05
EUR	100,000	ABN AMRO BANK FRN 29/03/49	128,863	123,313	0.03
GBP	50,000	STANDARD LIFE FDG FRN 29/06/49 EMTN	81,632	78,139	0.02
			<u>1,431,117</u>	<u>1,418,224</u>	<u>0.34</u>

通貨	数量/ 額面価格 ⁽¹⁾	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
国債					
EUR	300,000	NETHERLANDS GVT 1.75% 15/07/23	409,024	402,213	0.10
			409,024	402,213	0.10
ペイ・イン・カインド(PIK)債					
USD	400,000	SCHAEFFLER PIK 6.25% 15/11/19 144A	405,250	410,500	0.10
USD	200,000	SCHAEFFLER PIK 6.75% 15/11/22 144A	200,000	209,371	0.05
			605,250	619,871	0.15
普通社債(固定金利債)					
EUR	650,000	RABOBANK NED 3.875% 25/07/23	923,734	904,860	0.20
USD	750,000	NXP BV/NXP FD 3.75% 01/06/18 144A	755,938	750,596	0.17
USD	500,000	CONSTELLIUM NV 8% 15/01/23 144A	500,000	498,418	0.12
USD	250,000	LBC TANK TERM 6.875% 15/05/23 144A	263,750	251,250	0.06
USD	200,000	SCHAEFFLER FIN 4.75% 15/05/21 144A	200,000	200,331	0.05
USD	200,000	MARFRIG HLDG EUR 6.875% 24/6/19 14	203,500	188,215	0.04
EUR	100,000	BAYER CAP CORP 1.25% 13/11/23 EMTn	123,258	125,170	0.03
EUR	50,000	UPC HOLDING BV 8.375% 15/08/20 REGS	68,324	65,269	0.02
USD	25,000	SENSATA TECHNO 5.625% 01/11/24 144A	25,000	25,878	0.01
			3,063,504	3,009,987	0.70
		合計: オランダ	5,508,895	5,450,295	1.29
ニュージーランド					
国債					
NZD	250,000	NEW ZEAL GVT 5.5% 15/04/23 423	231,531	220,718	0.06
NZD	125,000	NEW ZEAL GVT 2.5% 20/09/35 CPI	99,503	100,084	0.02
NZD	125,000	NEW ZEAL GVT 2% 20/09/25 CPI	105,711	99,976	0.02
NZD	50,000	NEW ZEAL GVT 4.5% 15/04/27 0427	40,666	41,650	0.01
			477,411	462,428	0.11
		合計: ニュージーランド	477,411	462,428	0.11
プエルトリコ					
ステップアップ/ダウン債					
USD	155,000	PUERTO RICO SALES 0% 01/08/32	115,911	118,165	0.03
			115,911	118,165	0.03
普通社債(固定金利債)					
USD	445,000	PUERTO RICO CMWLTH 8% 01/07/35	396,649	384,831	0.10
USD	185,000	PUERTO RICO SALES FIRS 5.25% 1/8/41	140,017	127,622	0.04
USD	95,000	PUERTO RICO CMWL SERA 5.375% 1/7/33	74,456	68,093	0.02
USD	80,000	PUERTO RICO CMWLTH SERA 5.5% 1/7/26	65,300	60,636	0.01
USD	270,000	PUERTO RICO SALES 0% 01/08/34	46,842	50,963	0.01
USD	65,000	PUERTO RICO SALES TAX 6% 01/08/42	53,666	49,170	0.01
USD	35,000	PUERTO RICO CMWLTH IMP 5.75% 1/7/41	27,431	25,119	0.01
USD	25,000	PUERTO RICO SALES TAX 5.5% 01/08/37	20,442	18,281	0.00
USD	20,000	PUERTO RICO AQUE 5.25% 01/07/42	14,106	13,725	0.00
USD	15,000	PUERTO RICO SALES TAX 6% 01/08/39	12,480	11,405	0.00
USD	15,000	PUERTO RICO SALES TAX 5.75% 1/08/37	12,576	11,173	0.00
USD	15,000	PUERTO RICO SALES TAX 5% 01/08/35 C	11,464	10,435	0.00
USD	10,000	PUERTO RICO AQUE 5% 01/07/33	6,969	6,900	0.00
USD	5,000	PUERTO RICO SALES TAX 5.375% 1/8/36	3,934	3,577	0.00
USD	5,000	PUERTO RICO SALES TAX 5.375% 1/8/39	3,880	3,512	0.00
			890,212	845,442	0.20
		合計: プエルトリコ	1,006,123	963,607	0.23

通貨	数量/ 額面価格 ⁽¹⁾	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
韓国					
普通社債(固定金利債)					
USD	800,000	KOREA DEVEL BK 3% 14/09/22	794,056	802,826	0.19
USD	700,000	EXP-IMP BK KOREA 4% 29/01/21	743,370	748,672	0.18
		合計: 韓国	1,537,426	1,551,498	0.37
			1,537,426	1,551,498	0.37
ロシア					
その他債券					
USD	110,000	RUSSIAN FED FRN 31/03/30 REGS	74,815	75,202	0.02
		合計: ロシア	74,815	75,202	0.02
			74,815	75,202	0.02
シンガポール					
変動金利債					
USD	700,000	UTD OVERSEAS BK FRN 19/09/24 EMTN	705,361	710,024	0.17
		合計: シンガポール	705,361	710,024	0.17
			705,361	710,024	0.17
普通社債(固定金利債)					
USD	700,000	DBS BK SINGAPORE 3.625% 21/09/22 RE	723,244	721,496	0.17
		合計: シンガポール	723,244	721,496	0.17
			1,428,605	1,431,520	0.34
			1,428,605	1,431,520	0.34
南アフリカ					
国債					
ZAR	5,930,000	REP OF STH AFRICA 6.5% 28/2/41 R214	422,877	396,874	0.09
		合計: 南アフリカ	422,877	396,874	0.09
			422,877	396,874	0.09
普通社債(固定金利債)					
USD	400,000	KOREA WATER RES 2% 16/04/18	399,544	397,014	0.10
		合計: 南アフリカ	399,544	397,014	0.10
			822,421	793,888	0.19
			822,421	793,888	0.19
スペイン					
国債					
EUR	400,000	SPANISH GVT 4.4% 31/10/23	607,296	601,328	0.13
EUR	335,000	SPANISH GVT 5.15% 31/10/44	557,872	579,478	0.14
EUR	370,000	SPANISH GVT 4.65% 30/07/25	590,826	572,435	0.14
EUR	230,000	BONOS Y OBLIG DE EST 5.9% 30/07/26	394,769	392,399	0.09
EUR	300,000	SPANISH GOVT 0.55% 30/11/19 CPI	381,273	369,293	0.09
EUR	200,000	SPANISH GVT 2.75% 31/10/24	267,486	267,066	0.06
EUR	200,000	BONOS Y OBLIG DE EST 2.1% 30/04/17	257,426	252,230	0.06
EUR	40,000	SPANISH GVT 5.85% 31/01/22	67,928	63,909	0.02
		合計: スペイン	3,124,876	3,098,138	0.73
			3,124,876	3,098,138	0.73
普通社債(固定金利債)					
EUR	510,000	BONOS Y OBLIG DEL EST 4.5% 31/01/18	714,545	693,671	0.17
EUR	250,000	BONOS Y OBLIG DEL EST 0.5% 31/10/17	308,867	303,262	0.07
USD	200,000	ABENGOA GREENFIELD 6.5% 01/10/19 14	200,000	170,222	0.04
		合計: スペイン	1,223,412	1,167,155	0.28
			4,348,288	4,265,293	1.01
			4,348,288	4,265,293	1.01

通貨	数量/ 額面価格 ⁽¹⁾	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
スウェーデン					
変動金利債					
USD	200,000	NORDEA BANK AB FRN 29/09/49 144A	200,000	198,048	0.05
			200,000	198,048	0.05
国債					
SEK	15,000,000	SWEDISH GVT 1.5% 13/11/23 1057	2,107,723	2,027,069	0.48
			2,107,723	2,027,069	0.48
		合計: スウェーデン	2,307,723	2,225,117	0.53
スイス					
変動金利債					
USD	180,000	CREDIT SUISSE GR FRN 29/12/49 144A	178,425	173,819	0.04
			178,425	173,819	0.04
		合計: スイス	178,425	173,819	0.04
イギリス					
モーゲージ担保証券					
GBP	200,000	ESAIL 07-PRIX FRN 13/09/45	129,973	123,009	0.03
			129,973	123,009	0.03
変動金利債					
USD	350,000	RBS FRN 29/03/49 U	370,750	367,732	0.08
USD	250,000	BARCLAYS PLC FRN 30/06/49	243,125	238,750	0.06
USD	200,000	BARCLAYS BK PLC FRN 29/12/49	200,500	206,082	0.05
GBP	100,000	LLOYDS BANK FRN 16/12/21 EMTN	181,570	179,098	0.04
USD	135,000	HSBC HOLDINGS FRN 29/12/49	135,000	135,711	0.03
EUR	75,000	RBS FRN 16/03/22 EMTN	112,452	108,002	0.03
GBP	50,000	SCOTTISH WIDOWS PLC FRN 31/12/49	80,852	77,877	0.02
			1,324,249	1,313,252	0.31
国債					
GBP	880,000	UK TREAS GILT 3.25% 22/01/44	1,493,110	1,562,831	0.37
GBP	115,000	UK TREASURY 1.75% 07/09/22	184,047	180,946	0.04
			1,677,157	1,743,777	0.41
その他債券					
USD	375,000	MU FINANCE PLC 8.375% 01/02/17 144A	265,520	263,309	0.06
			265,520	263,309	0.06
普通社債(固定金利債)					
GBP	350,000	HSBC HLDGS PLC 6.75% 11/09/28	675,916	680,135	0.15
USD	600,000	VIRGIN MEDIA FIN 6% 15/10/24 144A	610,949	629,111	0.14
USD	600,000	CEVA GROUP PLC 7% 01/03/21 144A	595,875	579,922	0.13
USD	550,000	HSBC HDGS PLC 4.25% 14/03/24	566,102	572,293	0.14
USD	500,000	BARCLAYS BANK PLC 7.625% 21/11/22	548,125	548,561	0.13
USD	375,000	JAGUAR LAND ROV 8.125% 15/5/21 144A	415,969	411,765	0.10
USD	400,000	ABENGOA YIELD 7% 15/11/19 144A	400,000	394,509	0.09
EUR	300,000	GLAXOSMITHKLINE 0.625% 02/12/19 EM	370,860	367,865	0.09
USD	300,000	TULLOW OIL 6.25% 15/04/22 144A	255,000	252,473	0.06
EUR	200,000	ASTRAZENECA 0.875% 24/11/21 EMTN	248,174	245,034	0.06
USD	200,000	JAGUAR LAND ROV 4.25% 15/11/19 144	200,000	200,777	0.05
USD	200,000	ALGECO SCOTSMAN 8.5% 15/10/18 144A	208,750	194,174	0.05
USD	200,000	ALGECO SCOTSMAN 10.75% 15/10/19 144	190,000	173,206	0.04
GBP	100,000	ANGLIAN WATER 7% 31/01/18 EMTN	175,541	166,211	0.04
USD	125,000	RBS 1.875% 31/03/17	125,944	124,830	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 (%)
EUR	100,000	LLOYDS BANK 1% 19/11/21 EMTN	123,706	123,282	0.03
GBP	50,000	ROYAL BK SCOTLAND 9.625% 22/06/15	84,816	80,413	0.02
			5,795,727	5,744,561	1.35
		合計: イギリス	9,192,626	9,187,908	2.16
		アメリカ			
資産担保証券					
USD	465,000	GSAMP 06-HE1 M1 FRN 25/01/36	384,787	386,422	0.10
USD	415,000	GSAMP 05-HE6 M1 FRN 25/11/35	382,058	382,402	0.10
USD	420,000	INABS M3-05B FRN 25/08/35	381,413	381,399	0.09
USD	440,000	CARR 05-NC5 M1 FRN 25/10/35	381,150	381,271	0.09
USD	730,000	AMSI 04-R3 M1 FRN 25/05/34	382,619	380,125	0.09
USD	440,000	POPLR 05-4 M1 FRN 25/09/35	379,500	379,835	0.09
USD	415,000	LBMLT 05-1 M3 FRN 25/02/35	375,834	376,410	0.09
USD	2,200,000	PCHLT 05-4 1A2 FRN 25/12/35	356,205	355,971	0.08
USD	1,000,000	ELAT 07-2 A2E FRN 25/05/37	330,155	342,586	0.08
USD	425,000	RAMP 06 RZ1 M3 FRN 25/03/36	339,469	340,715	0.08
USD	307,332	MSAC 05-HE3 M4 FRN 25/07/35	266,611	271,544	0.06
USD	295,000	CMLT1 06-WFH1 M2 FRN 25/01/36	262,550	264,187	0.06
USD	250,000	RAMP 05-RS7 M1 FRN 25/07/35	216,563	216,867	0.05
USD	240,000	CARR 06-NC1 A4 FRN 25/01/36	192,150	187,224	0.04
USD	230,000	SVHE 07-1 2A3 FRN 25/03/37	187,519	182,882	0.04
USD	510,000	HEMT 04-5 M2 FRN 25/02/35	178,729	179,047	0.04
USD	200,000	ACE 06-ASP4 A2C FRN 25/08/36	115,472	115,076	0.03
USD	200,000	GSA 07-5 2A2A FRN 25/04/47	89,907	89,147	0.02
USD	100,000	CARR 06-RFC1 A4 FRN 25/05/36	80,375	81,104	0.02
			5,283,066	5,294,214	1.25
バンクローン					
USD	3,000,000	ALBERTSON'S FRN 25/08/21 TB4	2,987,812	3,005,999	0.70
USD	2,150,000	CLEAR CHANNEL COM FRN 30/07/19 TE01	2,140,874	2,060,301	0.48
USD	1,994,975	KINETIC CONCEPTS FRN 4/5/18 S TE1	1,987,493	1,969,209	0.46
USD	1,846,843	US FOODSERVICE FRN 31/03/19 TL01	1,842,721	1,838,301	0.42
USD	1,833,333	TIBCO SOFTWARE FRN 25/11/20 TL	1,741,666	1,782,916	0.41
USD	1,750,000	LEVEL 3 FIN FRN 31/01/22 TB	1,736,874	1,754,103	0.40
USD	1,750,000	TRAVEL PORT FRN 15/08/21 TL01	1,743,124	1,749,999	0.40
USD	1,745,536	HD SUPPLY FRN 28/06/18 TL	1,737,119	1,731,352	0.40
USD	1,705,556	BURGER KING/TIM FRN 24/09/21 TB01	1,688,749	1,701,998	0.39
USD	1,500,000	TRIBUNE CO FRN 27/12/20 TL01	1,491,249	1,477,973	0.34
USD	1,500,000	SERVICEMASTER FRN 16/6/21 INIT TL	1,489,374	1,474,553	0.34
USD	1,498,750	TELX GROUP FRN 09/04/20 INIT 1STL	1,490,568	1,461,281	0.34
USD	1,250,000	ENERGY FUT DIP/TXU FRN 19/06/16 TL	1,251,562	1,251,175	0.29
USD	1,250,000	METRO GOLDWYN FRN 26/6/20 2NDL TL01	1,248,124	1,237,500	0.28
USD	1,250,000	GATES GLOBAL FRN 12/6/21 INIT5 TL01	1,234,999	1,220,313	0.28
USD	1,214,286	ACOSTA INC FRN 26/09/21 INIT TL01	1,208,928	1,216,235	0.29
USD	1,225,806	ADVANTAGE SAL FRN 11/7/21 INIT 1STL	1,206,854	1,215,847	0.29
USD	1,193,716	BWAY HOLD FRN 08/08/20 INIT TL01	1,197,293	1,187,747	0.28
USD	1,121,951	ZEBRA TECHNO FRN INIT 27/10/21 TL01	1,113,536	1,129,244	0.27
USD	1,100,000	CERIDIAN CORP FRN 15/9/20 REPS1STTL	1,097,813	1,085,568	0.26
USD	1,022,462	SABRE FRN 18/02/19 TB	1,012,611	1,006,614	0.24
USD	1,000,000	EYEMART EXP LLC FRN 16/12/21 TL	995,000	997,500	0.24
USD	997,500	INTERACTIVE DATA FRN 23/04/21 TL	1,001,864	993,011	0.23
USD	1,000,000	U MEDIA GENERAL FRN 03/07/20 TB2	987,500	990,415	0.23
USD	997,462	IASIS HEALTHCARE FRN 03/05/18 TB201	999,956	990,400	0.23
USD	998,744	POLYMER GP FRN 19/12/19 INIT TL01	999,989	987,508	0.23
USD	998,721	INFOR US FRN 03/06/20 TB501	983,112	971,021	0.23
USD	989,969	CUMULUS MEDIA FRN 19/12/20 TL01	980,019	963,156	0.23
USD	967,824	CARECORE NTL INIT FRN 05/03/21 TL02	960,565	959,757	0.23

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	950,000	GOBP/GROCERY FRN 21/10/21 1STINITL	942,750	952,375	0.23
USD	1,000,000	COMPUWARE CORP FRN 11/12/21 TB201	950,000	951,460	0.22
USD	950,000	CENGAGE LEARN FRN 06/03/20 TL01	944,250	942,400	0.22
USD	947,870	NORD ANGLIA EDUC FRN 31/3/21 1STTL	942,259	940,761	0.22
USD	997,500	SOUTHCROSS NRG FRN 6/8/21 INIT TL	1,005,605	937,650	0.22
USD	948,744	BJS WHOLESALE FRN 26/9/19 1ST TL	939,005	933,834	0.22
USD	948,107	BLUE COAT SYS FRN 31/05/19 1ST TL	927,839	925,589	0.22
USD	928,677	HJ HEINTZ CO FRN 05/06/20 TB2	925,706	925,032	0.22
USD	900,000	U DAVITA HEALTH FRN 02/06/21 TB	896,625	892,535	0.21
USD	905,000	MA FINANCE/MICRO FRN 7/10/21 TBTLO1	864,275	878,135	0.21
USD	870,000	FIRST DATA FRN 24/03/18 2018 \$ TL01	862,100	854,505	0.20
USD	845,425	HARLAN CLARKE FRN 30/06/17 B2 TL02	848,043	842,957	0.20
USD	848,363	SEARS HLDG FRN 30/06/18 TL01	828,275	819,730	0.19
USD	850,000	NORANDA ALUMINIUM 17/02/19 TB01	817,750	816,000	0.19
USD	804,398	PRESTIGE FRN 15/08/21 TB2	800,376	805,070	0.19
USD	776,848	SMART&FINAL ST FRN 08/11/19 1STTL01	774,377	769,080	0.18
USD	750,000	PILOT TRAVEL FRN 30/09/21 INIT TB01	746,250	752,344	0.18
USD	750,000	SENSATA TECH FRN 8/10/21 THIRD AMTL	744,375	751,313	0.18
USD	748,747	AMERICAN TIRE FRN 19/06/18 INIT TL	748,745	750,619	0.18
USD	750,000	INC RESEARCH FRN 30/10/21 TL	742,500	749,374	0.18
USD	750,000	MATTRESS HDGS FRN 01/10/21 TL	744,688	747,656	0.18
USD	748,111	DELL INTL LLC FRN 29/04/20 TB	748,111	747,643	0.18
USD	750,000	PRO MACH GRP FRN 15/10/21 1ST \$ TL	742,500	747,188	0.18
USD	750,000	CITYCENTER HDGS FRN 09/10/20 TB01	750,938	745,076	0.18
USD	750,000	CONNOLLY FRN 14/05/21 ST TL	747,188	744,844	0.18
USD	748,750	GO DADDY OPER FRN 13/05/21 INITL	744,697	743,756	0.18
USD	748,082	UNITED SURGICAL FRN 19/4/17 EXTTL	745,277	743,406	0.18
USD	748,726	ZAYO GROUP LLC FRN 02/07/19 TL	742,487	742,414	0.18
USD	748,125	CATALENT PHARMA FRN 20/05/21 \$ TL	748,125	740,644	0.18
USD	750,000	NEW ALBERTSON FRN 24/06/21 TB01	741,563	740,393	0.18
USD	735,495	DRUMM INVEST FRN 04/05/18 TL01	741,012	739,173	0.17
USD	750,000	ALLIED SEC FRN 12/02/21 1ST TL01	738,750	738,986	0.17
USD	750,000	ATKORE INTL FRN 09/04/21 1ST TL01	746,250	737,813	0.17
USD	752,273	ABC SUPPLY FRN 05/04/20 TLB	742,765	730,645	0.17
USD	748,047	BMC INIT FRN 10/09/20 USD TL01	744,931	730,409	0.17
USD	748,750	FITNESS INT FRN 01/07/20 TL B	744,381	718,800	0.17
USD	718,337	LANDMARK AV FRN 25/10/19 US 1STL01	716,538	712,949	0.17
USD	717,902	DELTEK FRN 10/10/18 1ST TL03	715,210	711,147	0.17
USD	704,856	MINERALS TECH FRN 7/05/21 INIT TL	706,618	699,393	0.17
USD	700,000	DEALER TIRE FRN 17/12/21 INIT TL	693,000	697,375	0.16
USD	676,829	YORK RISK SVC FRN 1/10/21 INIT TL	670,907	674,572	0.16
USD	678,000	BERLIN PACK FRN 01/10/21 1STL	676,688	673,552	0.16
USD	676,304	MICRO HLDG FRN 08/07/21 INIT 1STL02	674,614	668,977	0.16
USD	670,192	NUMERICABLE US FRN 23/4/20 TB1	669,019	668,725	0.16
USD	670,000	MAGNUM HUNT RES 17/10/19 FRN 2ND TL	649,900	659,950	0.16
USD	661,611	PERFORMANCE FOOD FRN 14/11/19 TL	660,782	650,860	0.15
USD	650,000	U AVAGO TECHNO FRN 06/05/21 TL	649,188	649,054	0.15
USD	648,532	AVAYA FRN 30/03/18 TB601	646,404	639,797	0.15
USD	600,000	VIRGIN MEDIA FRN 07/06/20 TLB	589,625	590,241	0.14
USD	579,808	NUMERICABLE US LL FRN 23/4/20 TB2	578,793	578,538	0.14
USD	555,556	HILTON WORLDWIDE FRN 23/9/20 INITL01	552,083	549,481	0.13
USD	550,000	PACKERS HDG FRN 25/11/21 INIT TL	548,250	549,313	0.13
USD	550,000	U ONE CALL MED FRN 27/11/20 1ST TL	550,000	546,906	0.13
USD	544,783	BLACKBOARD FRN 04/10/18 TB3	546,826	540,697	0.13
USD	532,176	CARECORE NTL INIT FRN 05/03/21 TL01	528,185	527,740	0.12
USD	500,000	AMERICAN AIRLINES FRN 08/10/21 TB01	496,250	501,070	0.12
USD	500,000	U ALBERTSON'S LLC FRN 11/08/21 TB4	498,125	501,000	0.12
USD	500,000	ESH HOSPITALITY FRN 06/06/17 TL	505,625	500,315	0.12
USD	500,000	AURIS LUX III SIEM FRN 10/12/21 TB2	495,000	499,690	0.12
USD	500,000	U DELL LLC FRN 29/04/20 TB	497,500	499,688	0.12

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	498,747	CRC HEALTH FRN 28/03/21 1ST TB01	501,864	499,161	0.12
USD	500,000	U BURGER KING FRN 24/09/21 1ST TLB	496,250	498,958	0.12
USD	500,000	TRANSFIRST INC FRN 7/11/21 1st TL01	495,000	498,228	0.12
USD	500,000	CITGO PETROLEUM FRN 23/7/21 TB	502,500	497,915	0.12
USD	500,000	STHI HDGS FRN 30/07/21 INIT TL	498,125	497,708	0.12
USD	498,750	MILLENIU LABO FRN 15/04/21 TB	500,620	497,503	0.12
USD	500,000	AKORN FRN 16/04/21 TL	500,000	497,500	0.12
USD	500,000	LEVEL 3 FIN FRN 1/8/19 TLB3	498,125	497,190	0.12
USD	500,000	NATIONAL FIN PART FRN 01/07/20 TL	497,500	496,250	0.12
USD	500,000	VALEANT FRN 05/08/20 E1 TB TL01	499,375	496,095	0.12
USD	498,747	TRANS UNION LLC FRN 31/03/21 TL	492,513	495,006	0.12
USD	498,737	AMERICAN AIRLINE B FRN 27/6/19TL01	494,997	494,373	0.12
USD	500,000	SUPERVALU FRN 21/03/19 TL	498,125	492,853	0.12
USD	498,750	TRANSDIGM INC FRN 21/05/21 TD	493,763	491,900	0.12
USD	498,750	CIENA CORPORATION FRN 15/7/19 TL01	498,127	491,892	0.12
USD	498,741	USI COMPASS INVEST FRN 27/12/19 TL	492,506	491,571	0.12
USD	498,639	CAPITAL AUTOMOT FRN 19/03/19 TB101	498,016	489,913	0.12
USD	500,000	ALPHA TOPCO/DELTA FRN 30/7/21 TB301	496,875	489,125	0.12
USD	500,000	ALPHA TOPC FRN 29/7/22 2ND FAC TL01	501,875	488,750	0.12
USD	497,487	NEIMAN MARCUS FRN 25/10/20 TL01	493,756	487,709	0.12
USD	497,487	FREESCALE SEMI FRN 28/02/20 B4 TL01	495,622	487,694	0.12
USD	497,421	UNIVISION FRN 01/03/20 INC2013 TL01	493,690	487,597	0.12
USD	498,742	INEOS FRN 04/05/18 DOLLAR TL01	495,001	485,084	0.11
USD	489,796	CCM MERGER FRN 08/08/21 TLB	487,347	484,898	0.11
USD	497,494	HUB INTL LTD FRN 02/10/20 INIT TL01	491,275	484,228	0.11
USD	497,500	PATHEON INC FRN 23/01/21 \$ TL	492,525	484,025	0.11
USD	495,737	MPH ACQ FRN 19/03/21 INIT TL	484,673	483,963	0.11
USD	488,235	MICHAELS STOR FRN 28/1/20 INC TL	483,963	482,135	0.11
USD	479,855	AECOM TECH CORP FRN 17/09/21 TB01	478,055	480,754	0.11
USD	498,532	AVAYA FRN 26/10/17 TB301	482,330	479,124	0.11
USD	481,061	SOPHIA HLDGS FRN 19/07/18 TLB1	478,656	476,450	0.11
USD	470,000	U DTZ FRN 06/10/21 1ST TL	462,950	470,000	0.11
USD	470,331	LA QUINTA PROP FRN 14/04/21 INITL	466,216	466,018	0.11
USD	465,000	MUELLER WATER FRN 19/11/21 INI TL01	462,675	465,486	0.11
USD	460,288	DOOSAN FRN 27/05/21 TB01	461,439	457,987	0.11
USD	460,773	QUIKRETE FRN 28/09/20 INIT 1ST TL01	457,317	455,244	0.11
USD	450,000	IBC CAPITAL FRN 9/9/21 1ST INI TL01	450,000	449,062	0.11
USD	455,332	BERRY PLASTICS FRN 06/01/21 TE01	446,226	444,844	0.11
USD	450,000	U CERIDIAN HCM FRN 15/09/20 TL1	447,750	444,096	0.10
USD	438,238	KRONOS FRN 30/10/19 1ST LIEN TL01	437,690	435,793	0.10
USD	550,000	FTS INTL FRN 16/4/21 INIT TL01	539,340	431,063	0.10
USD	431,106	ZIGGO BV FRN 15/01/22 TB301	423,611	420,169	0.10
USD	412,500	BE AEROSPACE FRN 19/11/21 TL02	410,438	411,675	0.10
USD	412,500	BE AEROSPACE FRN 19/11/21 TL03	410,438	411,675	0.10
USD	412,500	BE AEROSPACE FRN 19/11/21 TL04	410,438	411,675	0.10
USD	412,500	BE AEROSPACE FRN 19/11/21 TL01	410,438	411,675	0.10
USD	425,000	MA FINANCE/MICRO 7/10/19 INITC TL01	403,750	408,531	0.10
USD	400,000	U EQUINOX FITNESS FRN 31/01/20 TL	399,000	397,500	0.09
USD	406,766	ZIGGO BV FRN 15/1/22 \$ TB101	399,694	396,446	0.09
USD	400,000	RENAISSANCE LEARN FRN 09/04/21 1STL	395,000	392,500	0.09
USD	398,995	BRICKMAN FRN 18/12/20 INITL 1STL	395,005	389,020	0.09
USD	387,522	RBS GLOBAL FRN 21/08/20 TB01	384,373	380,450	0.09
USD	389,300	UNIVAR INC NEW FRN 30/06/17 B01	389,300	377,804	0.09
USD	361,687	RBS GLOBAL FRN 21/08/20 TB02	358,748	355,086	0.08
USD	352,941	STYROLUTION DOL FRN 07/11/19 B1 TL2	345,882	343,676	0.08
USD	350,000	LINEAGE LOGIST FRN 07/04/21 TL	346,500	340,960	0.08
USD	337,127	PERFORMANCE FOOD FRN 14/11/19 TL02	336,704	331,648	0.08
USD	300,000	U SCIENTIFIC GAME FRN 01/10/21 TB2	294,375	296,400	0.07
USD	296,296	HILTON WORLDWIDE FRN 23/9/20 INITL02	294,444	293,056	0.07
USD	310,796	GARDNER FRN 23/07/20 INITIAL \$ TL01	308,465	291,906	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	280,000	DTZ FRN 04/11/21 1STL INIT TL03	275,800	280,000	0.07
USD	275,000	CLEAR CHANNEL COMM FRN 29/1/16 TB	273,063	272,799	0.06
USD	250,000	ALBERTSONS LLC FRN 25/8/21 TB41	248,750	250,500	0.06
USD	250,000	U INTRAWEST ULC FRN 09/12/20 TL	248,125	250,208	0.06
USD	250,000	U CAPITAL AUTO FRN 30/04/20 2ND TB	250,000	250,000	0.06
USD	250,000	U GO DADDY FRN 13/05/21 TB	248,125	248,333	0.06
USD	251,891	SPRINGER SCI FRN 14/8/20 INIT TB302	250,002	248,008	0.06
USD	250,000	VALEANT PHAR FRN 13/2/19 1L D2 TB	247,813	247,901	0.06
USD	250,000	MALLINCKRODT FRN 06/03/21 INIT TB01	247,500	245,224	0.06
USD	250,934	POWER BUYER FRN 06/05/20 1STL01	246,543	245,080	0.06
USD	248,272	RBS GLOBAL FRN 21/08/20 TB04	246,255	243,741	0.06
USD	246,156	PARTY CITY 14 REP FRN 27/07/19 TL04	242,257	241,387	0.06
USD	241,064	ZIGGO BV FRN 15/1/22 \$ TB201	236,873	234,948	0.06
USD	237,668	PARTY CITY 14 REP FRN 27/07/19 TL01	233,903	233,063	0.06
USD	227,942	IMG WORLDWIDE FRN 06/05/21 1ST TL01	225,092	221,105	0.05
USD	218,688	AMWINS FRN 06/09/19 1ST TL02	218,688	217,504	0.05
USD	218,750	BURLINGTON COAT FRN 13/08/21 TB302	217,109	216,472	0.05
USD	212,203	PARTY CITY 14 REP FRN 27/07/19 TL03	208,842	208,092	0.05
USD	200,000	U HUDSON BAY FRN 4/11/20 INIT 1STTL	199,500	200,292	0.05
USD	200,000	U PACKERS SANIT FRN 25/11/21 1TLB	198,000	199,750	0.05
USD	200,000	U IBC CAP/GOODPACK FRN 9/9/21 TL	200,000	199,583	0.05
USD	200,000	DOUGLAS DYNAMICS FRN 10/12/21 TL01	198,000	199,500	0.05
USD	199,500	SAGE PROD FRN 13/12/19 INIT 1STL01	198,503	198,752	0.05
USD	200,000	U SCIENTIFIC GAME FRN 18/10/20 TL	196,500	197,688	0.05
USD	200,000	U CERIDIAN LLC&HCM FRN 09/05/17 TB2	198,750	197,376	0.05
USD	196,875	BURLINGTON COAT FRN 13/08/21 TB303	195,398	194,825	0.05
USD	200,000	WARNER MUSI/WMG ACQ FRN 1/7/20 TB01	190,000	192,250	0.05
USD	170,627	SPRINGER SCI FRN 14/8/20 INIT TB301	169,347	167,997	0.04
USD	200,000	U FTS INTL TECH FRN 16/4/21 TLB	195,500	156,750	0.04
USD	156,766	U ZIGGO FRN 15/01/22 USD STRIP TB31	152,651	152,789	0.04
USD	150,000	OPAL ACQ FRN 21/11/20 1ST TB	149,625	149,156	0.04
USD	147,915	U ZIGGO FRN 15/01/22 USD STRIP TB11	144,032	144,162	0.03
USD	150,000	U NORANDA ALU FRN 28/02/19 TL B	145,625	144,000	0.03
USD	145,455	ABC SUPPLY FRN 05/04/20 TB04	143,616	141,273	0.03
USD	139,476	HARLAN CLARKE FRN 30/06/17 B2 TL01	139,908	139,069	0.03
USD	126,568	AMWINS FRN 06/09/19 1ST TL01	126,568	125,883	0.03
USD	108,063	BURLINGTON COAT FRN 13/08/21 TB301	107,252	106,937	0.03
USD	100,000	U CARECORE BRIDGE FRN 30/09/15 TL	100,000	100,000	0.02
USD	100,000	U AMWINS FRN 06/08/19 DD TL1	99,750	99,750	0.02
USD	100,000	U MATTRESS HDGS FRN 01/10/21 TL	99,250	99,688	0.02
USD	100,000	FIRST DATA FRN 24/03/21 EXT \$ TL	99,500	98,799	0.02
USD	100,000	U ABC SUPPLY FRN 16/04/20 1STLB	98,125	97,125	0.02
USD	100,000	U SEARS HLDGS FRN 30/06/18 1STL	97,250	96,625	0.02
USD	97,059	STYROLUTION \$ FRN 07/11/19 B1 TL01	95,118	94,511	0.02
USD	97,325	UNIVAR INC NEW FRN 30/06/17 B04	97,325	94,451	0.02
USD	95,319	U ZIGGO FRN 15/01/22 USD STRIP TB21	92,817	92,901	0.02
USD	74,811	CHS EXTENDED FRN 27/01/21 TD01	74,499	74,745	0.02
USD	75,000	U CALPINE CORP FRN 01/04/18 TL	74,438	74,414	0.02
USD	74,074	HILTON WORLWIDE FRN 23/9/20 INITL06	73,611	73,264	0.02
USD	73,171	YORK RISK SVC FRN 27/07/18 DD TL	72,896	72,927	0.02
USD	77,389	GARDNER FRN 23/07/20 INITIAL \$ TL02	76,809	72,686	0.02
USD	74,364	ADS WASTE HLDGS FRN 09/10/19 TB201	72,412	72,482	0.02
USD	53,730	AMWINS FRN 06/09/19 1ST TL03	53,730	53,439	0.01
USD	51,281	BWAY HOLD FRN 08/08/20 INIT TL03	51,435	51,024	0.01
USD	50,000	FIRST DATA 17 2ND FRN 24/03/17 TL01	49,250	49,381	0.01
USD	48,934	U INTERNET BRAND FRN 08/07/21 DD TL	48,812	48,404	0.01
USD	44,036	SPRINGER SCI FRN 14/8/20 INIT TB304	43,706	43,358	0.01
USD	43,337	AVAGO NEW HOLD FRN 16/04/21 TL	42,930	43,274	0.01
USD	35,000	MUELLER WATER FRN 19/11/21 TL02	34,825	35,037	0.01
USD	33,896	POWER BUYER FRN 06/05/20 1STL02	33,302	33,105	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	30,190	DELTEK FRN 10/10/18 1ST TL01	30,076	29,906	0.01
USD	28,511	LANDMARK AV FRN 25/10/19 CAD 1STL01	28,439	28,297	0.01
USD	28,552	PARTY CITY 14 REP FRN 27/07/19 TL05	28,100	27,999	0.01
USD	25,000	ARYSTA LIFE FRN 29/5/20 IN 1ST TL01	24,969	24,922	0.01
USD	25,000	HCA INC FRN 31/03/17 TB5	24,750	24,854	0.01
USD	24,937	DIAMONDS FOODS INC FRN 20/8/18 TL	24,781	24,797	0.01
USD	25,000	BRIGHT HORIZONS FRN 30/01/20 TB	24,688	24,695	0.01
USD	25,000	TRANSDIGM INC FRN 28/02/20 TL C01	24,563	24,625	0.01
USD	25,000	DELTA AIRLINES FRN 18/10/18 TB1	24,500	24,567	0.01
USD	25,000	SBA SENIOR FIN II FRN 24/03/21 TB1	24,375	24,556	0.01
USD	24,762	MICRO HLDG FRN 08/07/21 INIT 1STL01	24,700	24,493	0.01
USD	24,938	MEN'S WEARHOUSE FRN 18/06/21 TLB	24,813	24,439	0.01
USD	25,000	PINNACLE FOODS FRN 29/04/20 TG01	24,375	24,336	0.01
USD	25,000	U PINNACLE FOODS FRN 16/04/20 TG	24,563	24,336	0.01
USD	25,000	CHECKOUT HDGS FRN 09/04/21 1ST TB	24,406	23,906	0.01
USD	25,000	U CHECKOUT HDGS FRN 09/04/21 1ST TB	24,313	23,906	0.01
USD	24,165	PARTY CITY 14 REP FRN 27/07/19 TL02	23,782	23,696	0.01
USD	24,937	GETTY IMAGES FRN 18/10/19 INIT TL01	23,035	23,027	0.01
USD	21,064	ZIGGO BV FRN 15/01/22 TB2 02 TL	20,698	20,529	0.00
USD	20,808	IMG WORLDWIDE FRN 06/05/21 1ST TL02	20,548	20,184	0.00
USD	18,748	QUIKRETE FRN 28/09/20 INIT 1ST TL02	18,608	18,523	0.00
USD	18,128	SPRINGER SCI FRN 14/8/20 INIT TB303	17,992	17,848	0.00
USD	15,170	POWER BUYER DD FRN 06/05/20 1STL	14,905	14,816	0.00
USD	14,068	SPRINGER SCI FRN 14/8/20 INIT TB305	13,963	13,851	0.00
USD	12,097	ADVANTAGE SAL FRN 23/07/21 DD 1STL	11,885	11,998	0.00
USD	12,097	ADVANTAGE FRN 23/7/21 1ST DD TL02	12,097	11,998	0.00
USD	12,082	UNIVAR INC NEW FRN 30/06/17 TB05	12,082	11,725	0.00
USD	10,515	MICHAELS STOR FRN 28/1/20 INC TL	10,423	10,383	0.00
USD	6,538	AVAGO NEW HOLD FRN 16/04/21 TL02	6,477	6,529	0.00
USD	3,128	BWAY HOLD FRN 08/08/20 INIT TL04	3,138	3,112	0.00
USD	2,273	ABC SUPPLY FRN 05/04/20 TB06	2,244	2,207	0.00
USD	1,908	DELTEK FRN 10/10/18 1ST TL02	1,901	1,890	0.00
USD	1,819	LANDMARK AV FRN 25/10/19 US 1STL02	1,815	1,806	0.00
USD	1,256	NEIMAN MARCUS FRN 25/10/20 TL06	1,247	1,232	0.00
USD	1,256	FREESCALE SEMI FRN 28/02/20 B4 TL11	1,252	1,232	0.00
USD	1,253	HUB INTL LTD FRN 02/10/20 INIT TL03	1,237	1,220	0.00
USD	1,250	PATHEON INC FRN 23/01/21 TL03	1,238	1,216	0.00
USD	1,117	KRONOS FRN 30/10/19 1ST LIEN TL07	1,115	1,110	0.00
USD	1,010	MINERALS TECH FRN 7/05/21 INIT TL02	1,012	1,002	0.00
USD	1,005	BRICKMAN FRN 18/12/20 INITL 1STL02	995	980	0.00
USD	573	IMG WORLDWIDE FRN 06/05/21 1ST TL03	566	556	0.00
USD	500	SAGE PROD FRN 13/12/19 INIT 1STL02	498	498	0.00
USD	189	CHS EXTENDED FRN 27/01/21 TD04	188	189	0.00
USD	73	LANDMARK AV FRN 25/10/19 CAD 1STL02	73	72	0.00
USD	52	IMG WORLDWIDE FRN 06/05/21 1ST TL04	52	51	0.00
			121,225,283	120,580,173	28.50

モーゲージ担保証券

USD	933,000	AIREM 07-1A 2A1 FRN 20/09/66	716,310	706,585	0.16
USD	430,000	CMLTI 06-AR9 1A3 FRN 25/11/36	376,788	378,016	0.09
USD	425,000	SVHE 2005-D01 M5 FRN 25/05/35	375,063	375,778	0.09
USD	600,000	DBALT 07-OA3 A1 FRN 25/07/47	272,492	272,205	0.06
USD	2,100,000	GSMS 12-GCJ9 XA IO FRN 10/11/45	250,810	241,717	0.06
USD	650,000	LXS 06-16N A4A FRN 25/11/46	206,873	206,223	0.05
USD	1,000,000	CWALT 05-IMI A1 FRN 25/01/36	199,382	196,325	0.05
USD	600,000	RALI 2007-QH9 A1 FRN 25/11/37	172,839	170,101	0.04
USD	400,000	BSMF 07-AR5 2A1 FRN 25/06/37	157,701	158,238	0.04
USD	570,000	LXS 05-7N 1A1A FRN 25/12/35	115,181	116,479	0.03
USD	105,000	GCCFC 07-GG11 A4 5.736% 10/12/49	115,314	113,729	0.03
USD	200,000	IMSA 07-1 A2 FRN 25/03/37	102,093	101,112	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	800,000	IMJA 07-A1 A3 6% 25/08/37	85,542	83,260	0.02
USD	400,000	LUMI 06-7 1A1 FRN 25/12/36	84,511	82,867	0.02
USD	90,000	MLMI 05-A8 A3A3 FRN 25/08/36	77,850	77,263	0.02
			3,308,749	3,279,898	0.78
商業不動産担保証券					
USD	325,000	CSMC 07-C1 A3 5.383% 15/02/40	284,530	280,231	0.07
USD	226,000	GSMS 07-GG10 A4 FRN 10/08/45	224,085	220,923	0.05
USD	225,000	CSMC 06-C4 A3 5.467% 15/09/39	199,460	196,360	0.05
USD	2,400,000	WFRBS 14-C21 XA IO 1.36% 15/08/47	196,985	191,043	0.05
USD	175,000	GCFCF 07 GG9 A4 5.444% 10/03/39	189,937	186,559	0.04
USD	1,750,000	UBSBB 12-C4 XA IO FRN 10/12/45	180,329	175,182	0.04
USD	2,150,000	CGCMT 13-GC15 XA IO FRN 10/09/46	147,298	140,685	0.03
USD	125,000	CSMC 07-C4 A4 FRN 15/09/39	112,770	111,636	0.03
USD	115,000	CWCI 07-C3 A4 FRN 15/05/46	112,028	110,795	0.03
USD	100,000	WBCMT 07-C32 FRN 15/06/49	109,301	107,352	0.03
USD	100,000	CMLT 08 LS1 A4B FRN 10/09/17	101,582	100,174	0.02
USD	1,500,000	WFRBS 14-C22 XA IO 0.971% 15/09/57	98,023	97,129	0.02
USD	1,100,000	WFRBS 14-LC14 XA IO FRN 15/03/47	95,921	92,872	0.02
USD	1,115,000	CGCMT 13-GC17 XA IO FRN 10/11/46	89,189	85,395	0.02
			2,141,438	2,096,336	0.50
変動金利債					
USD	805,000	GOLDMAN SACHS FRN 29/12/49 L	820,623	813,049	0.20
USD	825,000	CITIGROUP INC FRN 29/12/49 HYBRID	822,312	812,624	0.19
USD	950,000	GOLDMAN SACHS CAP II FRN 01/12/49	732,812	699,437	0.17
USD	600,000	LINCOLN NATL CORP FRN 17/05/66	619,000	600,720	0.14
USD	550,000	BANK OF AMERICA CORP FRN 29/12/49	541,250	534,716	0.13
USD	464,000	JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/04/49 I	509,820	499,380	0.12
USD	463,000	CITIGROUP INC FRN 29/11/49 N	463,385	464,158	0.11
USD	420,000	MORGAN STANLEY FRN 29/07/49 H	420,968	422,646	0.10
USD	350,000	GE CAP TRUST I FRN 15/11/67	378,350	377,125	0.09
USD	325,000	BANK OF AMERICA CORP FRN 29/07/49 K	359,906	347,750	0.08
USD	325,000	ILFC E CAP TRUST I FRN 21/12/65 144	312,000	302,250	0.07
USD	250,000	JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/01/49	264,375	265,245	0.06
USD	255,000	BANK OF AMERICA CORP FRN 29/09/49 X	255,688	254,013	0.06
USD	250,000	ING US INC FRN 15/05/53	253,750	248,159	0.06
USD	225,000	ALLSTATE CORP FRN 15/08/53	241,425	237,102	0.06
USD	225,000	JPMORGAN CHASE CO FRN 29/12/49 V	222,625	221,526	0.05
USD	190,000	JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/12/49 R	194,028	189,719	0.04
USD	185,000	GENERAL ELEC CAP FRN 29/06/49	188,201	185,000	0.04
USD	180,000	AMERICAN EXPRESS FRN 29/05/49	180,000	182,835	0.04
USD	195,000	BANK OF AMERICA CORP FRN 29/12/49 U	186,186	179,888	0.04
USD	180,000	CITIGROUP INC FRN 29/12/49 M	181,405	177,750	0.04
USD	150,000	BANK OF AMERICA CORP FRN 23/10/49 Z	150,875	153,681	0.04
USD	150,000	PRUDENTIAL FIN FRN 5.2% 15/03/44	152,235	148,313	0.04
USD	141,000	ILFC E-CAP TR II FRN 21/12/65 144A	137,475	135,184	0.03
			8,588,694	8,452,270	2.00
投資信託					
--	155,400	POWERSHARES SENIOR LOAN	3,823,319	3,724,161	0.88
--	33,270	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING	3,808,149	3,676,002	0.87
--	34,500	ISHARES IBOXX USD H/Y CORP BOND BP	3,223,472	3,097,410	0.73
--	74,470	SPDR BARCLAYS CAPITAL HIGH ETF	3,053,524	2,884,223	0.68
--	25,800	ISHARES 0-5 HIGH YIELD CORP ET	1,300,313	1,253,106	0.30
--	16,100	ISHARES EMERGING MKTS LOC CUR ETF	805,337	740,761	0.18
--	14,800	ISHARES EMERGING MKTS CORP ETF	765,423	726,532	0.17
			16,779,537	16,102,195	3.81

通貨	数量/ 額面価格 ⁽¹⁾	銘柄名	取得時価	評価金額	組入比率 (%)
その他債券					
USD	550,000	IHEART COMM INC PIK 14% 01/20/21	552,928	448,821	0.10
USD	400,000	HOMER CITY GEN PIK 8.637% 01/10/19	395,441	394,021	0.09
USD	270,000	GENERAL MOTORS 5.2% 01/04/45	270,610	284,175	0.07
USD	200,000	AMER AIRL 13-2 B PT 5.6% 15/7/20 14	192,349	191,645	0.05
USD	170,000	AMER AIRLINES 14-1 B 4.375% 1/10/22	173,825	172,550	0.04
			1,585,153	1,491,212	0.35
ペイ・イン・カインド(PIK)債					
USD	900,000	FIRST DATA PIK 8.75% 15/01/22 144A	982,863	968,052	0.22
USD	200,000	CARLSON TRAVEL PIK 8.25% 15/8/19 14	201,000	200,721	0.05
USD	75,000	ANCESTRY PIK 9.625% 15/10/18 144A	76,500	73,564	0.02
USD	25,000	MARIPO/NEIMAN PIK 8.75% 15/10/21 14	25,750	26,538	0.01
			1,286,113	1,268,875	0.30
プール					
USD	5,940,908	FNCL POOL AE0825 6% 01/10/39	1,120,409	1,123,457	0.27
USD	104,620	FNCL POOL 901640 6% 01/12/36	8,266	8,288	0.00
USD	46,580	FNCL POOL 911567 6% 01/04/37	1,794	1,798	0.00
			1,130,469	1,133,543	0.27
ステップアップ/ダウン債					
USD	900,000	SABINE PASS LIQ 5.625% 15/04/23	852,624	885,031	0.22
USD	250,000	ENERGY FUT HDG 11.75% 01/03/22 144A	284,688	295,722	0.07
USD	250,000	REYNOLDS GRP ISS STUP 8.5% 15/05/18	259,313	255,762	0.06
USD	225,000	SERVICE CORP INTL 7% 15/06/17 WI	248,625	242,537	0.06
USD	200,000	REYNOLDS GRP ISS STUP 9% 15/04/19	210,900	206,853	0.05
USD	138,000	SALIX PHARMA 6% 15/01/2021 144A	136,445	141,323	0.03
USD	100,000	SABINE PASS LIQ 5.625% 01/02/21	98,500	98,286	0.02
USD	75,000	LINN NRG LLC/FIN STUP 01/11/19	58,750	62,334	0.01
USD	50,000	ARMORED AUTOGROUP INC STUP 1/11/18	51,625	49,793	0.01
			2,201,470	2,237,641	0.53
普通社債(固定金利債)					
USD	3,000,000	FED HOME LOAN BK 0.26% 21/07/15	3,002,249	3,003,515	0.70
USD	1,960,000	REYNOLDS GRP ISS 9.875% 15/08/19 WI	2,130,755	2,078,869	0.48
USD	1,712,000	SPRINT CORP 5.15% 15/09/23	1,849,247	1,700,506	0.39
USD	1,500,000	KINETICS/ KCI USA 10.5% 01/11/18	1,653,749	1,635,971	0.38
USD	1,425,000	SPRINT CORP 7.125% 15/06/24 WI	1,459,851	1,338,908	0.31
USD	1,190,000	CHS/COMM HEALTH 6.875% 01/02/22 WI	1,245,868	1,262,609	0.29
USD	1,171,000	T-MOBILE USA INC 6.731% 28/04/22	1,240,307	1,208,197	0.28
USD	1,100,000	LEAR CORP 5.25% 15/01/25	1,101,349	1,113,726	0.25
USD	1,100,000	HCA INC 3.75% 15/03/19	1,085,562	1,106,723	0.25
USD	1,025,000	CHS COMMUNITY 8% 15/11/19	1,113,468	1,094,854	0.25
USD	947,000	CINCINNATI BELL 8.375% 15/10/20	1,025,076	995,395	0.24
USD	920,000	NRG ENERGY INC 7.875% 15/05/21	1,005,862	991,950	0.23
USD	1,000,000	CHESAPEAKE ENERGY 4.875% 15/04/22	1,003,785	979,999	0.23
USD	982,000	BEAZER HOMES USA 5.75% 15/06/19	959,319	948,730	0.22
USD	885,000	DENALI BORROWER 5.625% 15/10/20 144	921,048	926,150	0.22
USD	600,000	DAIMLERCHRYSLER NA 8.5% 18/01/31	914,421	918,434	0.22
USD	819,000	SUNGARD DATA SYST 7.625% 15/11/20	866,739	868,759	0.21
USD	850,000	CENTURLINK INC 7.65% 15/03/42	849,264	864,062	0.20
USD	715,000	EL PASO NATURAL GAS 7.25% 01/06/18	821,524	808,693	0.19
USD	775,000	UNITED RENTALS 5.75% 15/11/24	777,524	801,957	0.19
USD	925,000	AVAYA INC 10.5% 01/03/21 144A	832,570	787,379	0.19
USD	800,000	AVAYA INC 7% 01/04/19 144A	793,874	784,839	0.19
USD	750,000	KCG HOLDINGS 8.25% 15/06/18 144A	778,124	769,198	0.18
USD	750,000	AVIS BUDGET CAR 5.125% 01/06/22 144	733,749	755,164	0.18
USD	680,000	CABLEVISION SYSTEMS 7.75% 15/04/18	758,718	751,903	0.18
USD	860,000	CALIFORNIA RES 6% 15/11/24 144A	809,302	745,698	0.18

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	650,000	ACTIVISION BLIZ 5.625% 15/9/21 144A	691,530	684,348	0.16
USD	690,000	SPRINGLEAF FIN CORP 5.25% 15/12/19	689,999	681,450	0.16
USD	650,000	DAVITA INC 6.625% 01/11/20	682,499	679,876	0.16
USD	650,000	CCO HLDGS LLC 7% 15/01/19	680,374	674,545	0.16
USD	661,000	CALPINE CORP 5.75% 15/01/25	652,425	669,208	0.16
EUR	500,000	GOLDMAM SACHS GP 2.5% 18/10/21 EMTN	676,051	660,551	0.16
USD	599,000	UNITED RENTALS 7.625% 15/04/22	667,232	657,982	0.16
USD	555,000	HCA INC 7.5% 15/02/22	642,637	638,002	0.15
USD	600,000	MGM RESORTS INTL 6.625% 15/12/21	653,194	632,633	0.15
USD	745,000	LINN ENERGY LLC/FIN 7.75% 1/2/21	764,499	624,904	0.15
USD	591,000	CCO HDGS LLC/CAP 6.5% 30/04/21	622,165	622,658	0.15
USD	600,000	VERIZON COMM 4.15% 15/03/24	622,757	621,101	0.15
USD	490,000	AMGEN INC 6.4% 01/02/39	609,113	620,489	0.15
USD	600,000	T-MOBILE USA INC 6.5% 15/01/24	612,576	616,303	0.15
USD	599,000	DISH DBS CORP 5.875% 15/11/24 144A	593,562	604,993	0.14
USD	600,000	KENNEDY WILSON 5.875% 01/04/24	599,999	604,349	0.14
USD	575,000	K HOVNANIAN ENT 7.25% 15/10/20 144A	610,374	595,891	0.14
USD	430,000	FHLB 5.5% 15/07/36	576,049	590,314	0.14
USD	825,000	HEXION US FINANCE 9% 15/11/20	801,249	586,590	0.14
USD	600,000	SONIC AUTO INC 5% 15/05/23	584,812	586,281	0.14
USD	600,000	APPLE INC 2.4% 03/05/23	575,674	584,662	0.14
USD	545,000	UNIVISION COMM 7.875% 01/11/20 144A	588,512	582,153	0.14
USD	500,000	AVIATION CAP GR 7.125% 15/10/20 144	577,499	574,882	0.14
USD	540,000	LEVEL 3 FINANCING 8.125% 01/7/19 WI	574,549	571,392	0.14
USD	535,000	CLEAR CHAN WLD 7.625% 15/3/20 WI-B	563,762	564,958	0.13
USD	550,000	ALLY FINANCIAL INC 5.125% 30/09/24	540,770	563,816	0.13
USD	530,000	CHRYSLER GP 8% 15/06/19 WI	569,988	560,840	0.13
USD	553,000	POST HLDGS 7.375% 15/02/22	581,908	556,690	0.13
USD	524,000	FREESCALE SEMIC 6% 15/01/22 144A	548,073	545,823	0.13
USD	550,000	CLAIRE'S ST 9% 15/03/19 144a	562,063	542,298	0.13
USD	525,000	HD SUPPLY INC 5.25% 15/12/21 144A	526,344	535,820	0.13
USD	525,000	T-MOBILE USA INC 6% 01/03/23	526,956	529,970	0.13
USD	550,000	WEST CORP 5.375% 15/07/22 144A	528,125	527,671	0.12
USD	500,000	HD SUPPLY INC 7.5% 15/07/20	534,375	525,590	0.12
USD	500,000	ALLY FINANCIAL INC 5.5% 15/02/17	529,519	525,181	0.12
USD	500,000	UNITED CONTINENTAL 6.375% 01/06/18	529,375	524,139	0.12
USD	500,000	T-MOBILE USA INC 5.25% 01/09/18	516,875	519,098	0.12
USD	500,000	AUX NORTH AMER 6.125% 1/11/23 1	522,500	518,526	0.12
USD	575,000	ORTHO-CLINICAL 6.625% 15/05/22 144A	545,469	517,747	0.12
USD	500,000	DISH DBS CORP 4.625% 15/07/17	520,625	517,747	0.12
USD	525,000	GROUP 1 AUTO 5% 01/06/22 144A	519,625	514,194	0.12
USD	502,000	CLEAR CHAN WLD 6.5% 15/11/22 WI	528,675	512,998	0.12
USD	500,000	MORGAN STANLEY 3.75% 25/02/23	505,517	512,873	0.12
USD	500,000	LEE ENTERPRISES 9.5% 15/03/22 144A	520,625	512,057	0.12
USD	500,000	CCO HDGS LLC/CAP 5.75% 01/09/23	502,500	508,545	0.12
USD	475,000	UNIVISION COMM 8.5% 15/05/21 144A	518,943	506,236	0.12
USD	395,000	VERIZON COMM 6.55% 15/09/43	499,562	505,145	0.12
USD	450,000	NUSTAR LOGISTICS 7.65% 15/04/18	510,750	504,851	0.12
USD	465,000	LEVI STRAUSS&CO 6.875% 01/05/22	506,625	503,960	0.12
USD	500,000	REGENCY ENERGY 5.875% 01/03/22	537,500	498,437	0.12
USD	500,000	KB HOME 4.75% 15/05/19	495,000	493,070	0.12
USD	500,000	ALLY FINANCIAL INC 3.5% 27/01/19	505,000	491,773	0.12
USD	500,000	SPRINT CAPITAL 8.75% 15/03/32	516,600	490,000	0.12
USD	500,000	ANHEUSER-BUSH INBEV 2.5% 15/07/22	481,000	485,876	0.11
USD	480,000	MGM RESORTS INTL 6% 15/03/23	475,656	482,400	0.11
USD	475,000	LEVEL 3 ESCROW 5.375% 15/08/22 144A	472,031	478,255	0.11
USD	490,000	FREEPORT-MCMORAN 4.55% 14/11/24	485,440	476,882	0.11
USD	500,000	SUMMIT MID HDGS 5.5% 15/08/22	505,000	475,954	0.11
USD	450,000	MICRON TECH INC 5.875% 15/02/22 144	465,750	474,375	0.11
USD	444,000	SPRINGLEAF FIN CORP 6.9% 15/12/17 M	482,805	470,956	0.11

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	BMC SOFTWARE 8.125% 15/07/21 144A	505,625	470,759	0.11
USD	569,000	ASSOC MATERIAL 9.125% 01/11/17	541,370	469,769	0.11
USD	450,000	MPH ACQUISIT HDG 6.625% 1/04/22 14	461,219	465,431	0.11
USD	474,000	GENWORTH FINANCIAL 7.625% 24/09/21	485,767	463,125	0.11
USD	414,000	HUGHES SATELITE 7.625% 15/06/21	462,500	457,176	0.11
USD	400,000	SPRINT NEXTEL 9% 15/11/18 144A	471,525	455,381	0.11
USD	450,000	FRESENIUS MED 4.125% 15/10/20 144A	450,000	452,897	0.11
USD	425,000	CIT GROUP INC 5.5% 15/02/19 144A	453,645	448,830	0.11
USD	439,000	AMERICAN AIRLINES 5.5% 1/10/19 144A	438,176	446,710	0.11
USD	450,000	SABINE PASS LIQ 5.75% 15/05/24	452,929	444,304	0.11
USD	400,000	CHRYSLER GP 8.25% 15/06/21 WI	442,750	443,702	0.10
USD	500,000	ADVANCED MICRO 7% 01/07/24	511,250	428,445	0.10
USD	375,000	MGM RESORTS INTL 8.625% 01/02/19	429,438	427,891	0.10
USD	400,000	LYNX II CORP 6.375% 15/04/23 144A	425,500	418,768	0.10
USD	400,000	ASHTAD CAPITAL 5.625% 1/10/24 144	407,000	410,960	0.10
USD	390,000	AMERISTAR CASINOS 7.5% 15/04/21	412,425	407,996	0.10
USD	400,000	CALPINE CORP 5.375% 15/01/23	398,266	404,808	0.10
USD	400,000	VOLKSWAGEN GRP 2.45% 20/11/19 REGS	399,104	401,658	0.09
USD	365,000	HUNTSMAN INT LLC 8.625% 15/03/21	395,386	392,622	0.09
USD	365,000	BIOMET INC 6.5% 01/08/20	391,798	390,799	0.09
USD	375,000	RITE AID CORP 6.75% 15/06/21 WI	389,375	385,901	0.09
USD	395,000	DISH DBS CORP 5% 15/03/23	386,588	383,003	0.09
USD	375,000	SELECT MEDICAL 6.375% 01/06/21	379,188	382,164	0.09
USD	375,000	MICRON TECHNO 5.5% 01/02/25 144A	369,635	381,069	0.09
USD	365,000	CEQUEL COM HLD 6.375% 15/09/20 144A	380,300	380,090	0.09
USD	425,000	HEXION US/NOVA 8.875% 01/02/18	425,813	377,466	0.09
USD	350,000	TENET HEALTHCARE 6% 01/10/20	380,065	375,954	0.09
USD	350,000	HCA HLDG 7.75% 15/05/21	376,590	374,724	0.09
USD	317,000	MGM MIRAGE 11.375% 01/03/18	386,713	372,689	0.09
USD	350,000	LIFEPOINT HOSP 6.625% 01/10/20	372,875	369,504	0.09
USD	350,000	WINDSTREAM CORP 7.75% 15/10/20	376,475	360,954	0.09
USD	350,000	NRG ENERGY 6.25% 01/05/24 144A	358,729	359,539	0.08
USD	325,000	PANTRY INC 8.375% 01/08/20	346,125	358,487	0.08
USD	300,000	GENERAL MOTORS 6.25% 02/10/43	348,141	357,000	0.08
USD	350,000	STEEL DYNAMICS 5.125% 01/10/21 144A	350,625	355,908	0.08
USD	350,000	IHS INC 5% 01/11/22 144A	350,000	347,228	0.08
USD	307,000	TEKNI PLEX INC 9.75% 01/06/19 144A	335,578	333,349	0.08
USD	375,000	SPRINT CAP CORP 6.875% 15/11/28	362,563	332,813	0.08
USD	310,000	WYNN LAS VEGAS 7.75% 15/08/20	331,444	329,971	0.08
USD	314,000	FRONTIER COMM 7.625% 15/04/24	334,519	328,854	0.08
USD	350,000	CONSOL ENERGY 5.875% 15/04/22 144A	354,375	326,124	0.08
USD	315,000	DANA HOLDING CO 5.375% 15/09/21	327,994	324,201	0.08
USD	300,000	CHECKERS DRIVE-IN 11% 01/12/17 144A	327,750	324,131	0.08
USD	325,000	CENTURYTEL INC 7.6% 15/09/39 P	327,688	322,974	0.08
USD	325,000	OMEGA HEALTHL INV 4.5% 15/01/25 144A	322,176	321,657	0.08
USD	297,000	MERITAGE HOMES 7.15% 15/04/20 WI	324,473	319,716	0.08
USD	325,000	HEXION US FIN 6.625% 15/04/20 WI	336,125	318,949	0.08
USD	312,000	NEWFIELD EXPLOR 6.875% 01/02/20	324,090	317,077	0.07
USD	325,000	MIDAS INT HOLD 7.875% 01/10/22 144A	322,563	315,832	0.07
USD	350,000	UNIT CORP 6.625% 15/05/21	341,250	313,771	0.07
USD	300,000	US AIRWAYS GROUP 6.125% 01/06/18	315,000	311,483	0.07
USD	263,000	ALLY FINANCIAL INC 8% 15/03/20	315,455	310,748	0.07
USD	305,000	TENET HEALTHCARE 5.5% 1/03/19 144A	304,744	310,510	0.07
USD	302,000	WINDSTREAM CORP 7.75% 01/10/21	318,987	310,034	0.07
USD	300,000	DISH DBS CORP 4.25% 01/04/18	304,500	307,723	0.07
USD	275,000	SEALED AIR CORP 8.375% 15/09/21 144	309,905	307,440	0.07
USD	300,000	T-MOBILE USA 6.625% 01/04/23	317,130	305,848	0.07
USD	304,000	MERITAGE HOMES CORP 4.5% 1/03/18	306,135	304,216	0.07
USD	300,000	CCOH SAFARI 5.75% 01/12/24	298,438	303,719	0.07
USD	285,000	BOISE CASCADE CO 6.375% 01/11/20	299,963	299,609	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	285,000	FIRST DATA CORP 7.375% 15/6/19 144A	301,488	299,452	0.07
USD	324,000	COTT BEVERAGES 5.375% 01/07/22 144	311,308	298,673	0.07
USD	300,000	CORPORATE OFF 3.7% 15/06/21	301,677	298,673	0.07
USD	376,000	GETTY IMAGES 7% 15/10/20 144A	319,600	295,612	0.07
USD	308,000	NAVIENT CORP 5.875% 25/10/24	305,151	294,863	0.07
USD	300,000	SM ENERGY CO 6.625% 15/02/19	311,625	294,302	0.07
USD	450,000	WARREN RESOURCES 9% 01/08/22 144A	282,375	292,981	0.07
USD	300,000	LMI AEROSPACE INC 7.375% 15/07/19 1	301,500	292,839	0.07
USD	270,000	VIKING CRUISES 8.5% 15/10/22 144A	297,525	292,708	0.07
USD	279,000	ARAMARK CORP 5.75% 15/03/20	289,412	287,011	0.07
USD	280,000	KINDER MORGAN INC 5.55% 01/06/45	279,056	286,811	0.07
USD	275,000	COTT BEVERAGES 6.75% 01/01/20 144A	275,000	275,698	0.07
USD	290,000	ASHTON WOODS USA 6.875% 15/2/21 144	285,150	274,487	0.06
USD	250,000	FREESCALE SEMIC 10.75% 01/08/20	278,750	273,902	0.06
USD	262,000	FIRST CASH FIN 6.75% 01/04/21	276,160	272,892	0.06
USD	256,000	GOOD TIRE&RUBBER 6.5% 01/03/21	271,906	272,318	0.06
USD	250,000	RSC EQUIP RENT 8.25% 01/02/21	275,938	272,317	0.06
USD	250,000	INTL LEASE FINANCE 5.875% 15/08/22	274,063	271,793	0.06
USD	275,000	SLM CORP 6.125% 25/03/24 MTN	281,375	270,815	0.06
USD	255,000	ZEBRA TECH 7.25% 15/10/22 144A	262,344	270,124	0.06
USD	260,000	HERTZ CORP 6.75% 15/04/19	271,445	269,289	0.06
USD	270,000	SANMINA CORP 4.375% 01/06/19 144A	267,000	268,291	0.06
USD	250,000	LANDRY'S INC 9.375% 01/05/20 144A	269,688	265,941	0.06
USD	250,000	DANA HOLDING CO 6.75% 15/02/21	265,625	265,198	0.06
USD	250,000	MARIPOSA BOR 8% 15/10/21 144A	256,438	265,070	0.06
USD	250,000	DANA HOLDING CO 6% 15/09/23	265,625	262,994	0.06
USD	350,000	NORTHERN OIL AND GAS 8% 01/06/20 W1	339,500	262,868	0.06
USD	250,000	HILTON WORLDWI 5.625% 15/10/21	262,625	260,984	0.06
USD	250,000	LEVEL 3 FIN INC 6.125% 15/1/21	263,750	260,351	0.06
USD	245,000	HEALTHSOUTH CORP 7.75% 15/09/22	262,456	259,881	0.06
USD	245,000	DAVITA INC 5.75% 15/08/22	261,538	259,805	0.06
USD	250,000	LIFEPOINT HOSPI 5.5% 01/12/21	262,188	257,315	0.06
USD	250,000	STANDARD PACIFIC 6.25% 15/12/21	264,870	256,708	0.06
USD	276,000	WHITING PETROLEUM 5.75% 15/03/21	248,533	256,680	0.06
USD	235,000	UNITED RENTALS 7.375% 15/05/20	255,445	253,953	0.06
USD	235,000	HUGHES SATELITE 6.5% 15/06/19	255,938	252,706	0.06
USD	250,000	GENERAL MOTORS 3.25% 15/05/18	249,688	252,007	0.06
USD	268,000	GRIFFON CORP 5.25% 01/03/22	258,278	251,399	0.06
USD	225,000	HCA INC 6.50% 15/02/20	250,750	251,213	0.06
USD	250,000	EQUINIX INC 5.375% 01/01/22	248,938	251,082	0.06
USD	251,000	FRONTIER COMM 6.875% 15/01/25	250,063	250,967	0.06
USD	250,000	CENTRAL GARDEN & PET 8.25% 01/03/18	248,125	250,788	0.06
USD	275,000	DENBURY RES 5.5% 01/05/22	274,125	250,738	0.06
USD	250,000	TENET HEALTHCARE 5% 01/03/19 144A	255,000	250,580	0.06
USD	250,000	HOCKEY MERG 7.875% 01/10/21 144A	260,000	250,409	0.06
USD	250,000	TRIUMPH GROUP 5.25% 01/06/22	249,375	249,846	0.06
USD	250,000	REALOGY CORP 4.5% 15/04/19 144A	246,538	249,657	0.06
USD	250,000	ALLIANCE DATA SYST 5.375% 1/08/22 1	242,250	247,358	0.06
USD	250,000	BELDEN INC 5.5% 01/09/22 144A	256,250	246,735	0.06
USD	235,000	ALCATEL LUCENT 6.75% 15/11/20 144A	237,350	245,896	0.06
USD	250,000	SBA COMM CORP 4.875% 15/07/22 144A	246,875	241,737	0.06
USD	235,000	CONCHO RESOURCES 5.5% 01/04/23	229,713	237,825	0.06
USD	275,000	PEABODY ENERGY CORP 6.25% 15/11/21	268,375	237,613	0.06
USD	226,000	GLP CAP LP 4.375% 01/11/18	230,238	231,296	0.05
USD	200,000	QWEST CORP 6.75% 01/12/21	231,438	231,111	0.05
USD	225,000	AVIS BUDGET CAR 5.5% 01/04/23	225,563	228,836	0.05
USD	235,000	CARRIZO OIL&GAS INC 7.5% 15/9/20 14	237,488	225,933	0.05
USD	225,000	REVLON CONSUMER 5.75% 15/02/21	227,483	225,911	0.05
USD	200,000	JARDEN CORP 7.5% 01/05/17	220,000	220,091	0.05
USD	300,000	FTS INT 6.25% 01/05/22 144A	287,625	216,401	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	231,000	PLY GEM INDS 6.5% 01/02/22 144a	225,633	215,220	0.05
USD	198,000	LEVEL 3 FINANCING 8.625% 15/7/20 WI	219,285	214,933	0.05
USD	225,000	KINDRED HEALTH 6.375% 15/04/22 144A	227,031	214,151	0.05
USD	200,000	AMERICAN EQU INV 6.625% 15/07/21	213,500	212,796	0.05
USD	219,000	ANTERO RESOURCE FIN 5.375% 01/11/21	203,968	212,273	0.05
USD	210,000	AIR LEASE CORP 4.25% 15/09/24	208,312	212,134	0.05
USD	250,000	SANCHEZ NRG CORP 6.125% 15/1/23 14	235,960	209,173	0.05
USD	200,000	HEALTHSOUTH CORP 8.125% 15/02/20	213,000	208,398	0.05
USD	200,000	BUILDING MATERIALS 9% 15/09/18 144A	212,313	208,127	0.05
USD	200,000	BUILDERS FIRSTS 7.625% 01/06/21 144	209,250	205,304	0.05
USD	200,000	METLIFE INC 3.6% 10/04/24	203,324	205,238	0.05
USD	190,000	SONIC AUTOMOTIVE 7% 15/07/22	207,100	204,519	0.05
USD	200,000	DYNEGY FINANCE 1 7.625% 1/11/24 144	201,938	204,468	0.05
USD	200,000	ACCESS MIDST PART 4.875% 15/05/23	206,375	203,418	0.05
USD	200,000	HCA INC 4.25% 15/10/19	198,000	203,273	0.05
USD	200,000	ALCATEL-LUCENT 4.625% 01/07/17 144A	201,000	202,098	0.05
USD	200,000	TRANSDIGM INC 6.5% 15/07/24	206,750	201,939	0.05
USD	200,000	CABLEVISION SYSTEMS 5.875% 15/09/22	193,500	201,906	0.05
USD	200,000	EQUINIX INC 5.375% 01/04/23	204,500	200,914	0.05
USD	200,000	FFCB 0.25% 02/12/15	199,976	200,048	0.05
USD	200,000	SLM CORP 4.875% 17/06/19 MTN	204,000	199,735	0.05
USD	190,000	EDUCATION REALT 4.6% 01/12/24	189,983	194,706	0.05
USD	190,000	ISLE OF CAPRI CAS 5.875% 15/03/21	194,300	193,627	0.05
USD	225,000	PHI INC 5.25% 15/03/19	223,313	191,469	0.05
USD	200,000	DYNEGY INC 5.875% 01/06/23	187,563	191,407	0.05
USD	190,000	CDW LLC/FIN 5.5% 01/12/24	189,300	190,001	0.04
USD	175,000	MEDTRONIC INC 4.625% 15/3/45 144A	181,291	189,716	0.04
USD	200,000	PLY GEM INDS 6.5% 01/02/22	199,000	188,342	0.04
USD	175,000	CCO HDGS LLC 7.375% 01/06/20	187,688	186,270	0.04
USD	175,000	SALLY HDGS/CAP 6.875% 15/11/19	188,563	186,050	0.04
USD	200,000	JEFFERIES FIN LLC 7.5% 15/04/21 144	200,000	185,798	0.04
USD	175,000	HOLOGIC INC 6.25% 01/08/20	183,645	182,162	0.04
USD	175,000	ALERE INC 8.625% 01/10/18	182,875	181,211	0.04
USD	170,000	SPIRIT AEROSYSTEM 6.75% 15/12/20 WI	181,050	180,307	0.04
USD	175,000	DYNEGY FINANCE 1 7.375% 1/11/22 144	170,806	178,845	0.04
USD	175,000	CEDAR FAIR LP 5.25% 15/03/21	177,375	177,031	0.04
USD	175,000	BUILD MAT CORP 5.375% 15/11/24 144A	175,000	174,988	0.04
USD	175,000	FREESCALE SEMIC 5% 15/05/21 144A	173,188	173,109	0.04
USD	220,000	BREITBURN ENER 7.875% 15/04/22	227,700	171,900	0.04
USD	175,000	HARLAND CLARKE 6.875% 01/03/20 144A	178,219	170,859	0.04
USD	200,000	UNIVERSAL HOSPITAL 7.625% 15/08/20	201,250	167,244	0.04
USD	175,000	REGAL ENTERTAINMENT 5.75% 15/06/23	168,575	164,855	0.04
USD	150,000	ENTERTAINMENT PROP 5.75% 15/08/22	166,284	163,856	0.04
USD	150,000	AMC ENTERTAINMENT 9.75% 01/12/20	165,375	163,214	0.04
USD	164,000	CARRIZO OIL&GAS 8.625% 15/10/18	170,199	162,503	0.04
USD	162,000	LIVE NATION ENT 5.375% 15/06/22 144	164,025	162,302	0.04
USD	165,000	TRINITY INDUSTRIES 4.55% 1/10/24	164,815	160,248	0.04
USD	150,000	HCA HLDG 6.25% 15/02/21	159,938	160,009	0.04
USD	150,000	CHS COMMUNITY 7.125% 15/07/20	161,438	159,526	0.04
USD	150,000	LEVEL 3 FIN INC 9.375% 01/04/19 WI	162,738	159,100	0.04
USD	150,000	WR GRACE & CO 5.625% 01/10/24 144A	152,875	156,768	0.04
USD	165,000	APACHE CORP 4.75% 15/04/43	169,311	155,911	0.04
USD	132,000	ALLY FINANCIAL INC 7.5% 15/09/20 WI	153,080	155,260	0.04
USD	161,000	K HOVNANIAN ENT 8% 01/11/19 144A	161,000	154,754	0.04
USD	150,000	MARKWEST ENERGY PART 6.5% 15/08/21	152,625	154,353	0.04
USD	150,000	SIRIUS XM RADIO 6% 15/07/24 144A	156,563	154,096	0.04
USD	150,000	PINNACLE ENTERT 6.375% 01/08/21	158,396	152,872	0.04
USD	150,000	KLX INC 5.875% 01/12/22 144A	151,266	151,419	0.04
USD	150,000	ICAHN ENTS FIN 5.875% 01/02/22	150,750	151,012	0.04
USD	140,000	NRG ENERGY INC 8.25% 01/09/20	148,225	149,546	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	150,000	ICAHN ENTR/FIN 4.875% 15/03/19 WI	149,813	149,411	0.04
USD	150,000	GENON ENERGY INC 9.5% 15/10/18	158,563	149,380	0.04
USD	150,000	CEDAR FAIR/CANA 5.375% 01/06/24 144	149,250	149,221	0.04
USD	150,000	RR DONNELLEY 6% 01/04/24	145,875	147,344	0.03
USD	150,000	AMKOR TECHNO INC 6.375% 01/10/22	158,250	145,033	0.03
USD	136,000	ONEMAIN FIN 7.25% 15/12/21 144A	136,330	138,607	0.03
USD	132,000	CLEAR CHANNEL WORL 7.625% 15/3/20 A	137,610	137,415	0.03
USD	250,000	HERCULE OFFSHORE 10.25% 01/04/19 14	271,875	133,907	0.03
USD	125,000	MSCI INC 5.25% 15/11/24 144A	125,500	129,978	0.03
USD	125,000	WELLCARE HEALTH 5.75% 15/11/20	129,844	129,236	0.03
USD	100,000	ALLY FINANCIAL 8% 01/11/31	125,000	127,643	0.03
USD	125,000	DIRECT TV HDGS 3.95% 15/01/25	124,141	126,912	0.03
USD	125,000	OWENS-BROCKWAY 5.375% 15/01/25 144A	126,031	126,732	0.03
USD	151,000	SUN PRODUCTS 7.75% 15/03/21 144A	120,045	126,283	0.03
USD	110,000	ENERGY TRANSF PARTN 6.5% 01/02/42	129,600	126,277	0.03
USD	125,000	NIELSEN FIN LLC 5% 15/04/22 144A	126,063	125,859	0.03
USD	125,000	WILLIAM LYON HOM 5.75% 15/04/19	125,625	125,136	0.03
USD	130,000	LUCENT TECHNOLOGIES 6.45% 15/03/29	119,925	124,505	0.03
USD	131,000	SM ENERGY CO 6.125% 15/11/22 144A	125,869	123,388	0.03
USD	120,000	KINDER MORGAN 5.5% 01/03/44	113,872	122,580	0.03
USD	110,000	KINDER MORGAN ENE 6.5% 01/09/39	127,018	122,411	0.03
USD	225,000	ENERGY XXI GULF 7.5% 15/12/21	231,500	121,696	0.03
USD	130,000	NOBLE ENERGY INC 5.05% 15/11/44	129,045	120,679	0.03
USD	125,000	CIMAREX ENERGY 4.375% 01/06/24	126,844	119,052	0.03
USD	125,000	ANTERO RESOURCE 5.125% 1/12/22 144	114,125	118,686	0.03
USD	133,000	CALIFORNIA RES 5% 15/01/20 144A	130,200	118,207	0.03
USD	115,000	CITGO PETROLEUM 6.25% 15/08/22 144A	121,025	116,941	0.03
USD	125,000	SCIENTIFIC GAMES INTL 10% 1/12/22 1	112,331	115,199	0.03
USD	150,000	HALCON RESOURCES 8.875% 15/05/21	142,750	112,671	0.03
USD	100,000	VERIZON COMM 5.15% 15/09/23	111,777	110,579	0.03
USD	100,000	COMCAST CORP 4.65% 15/07/42	106,287	108,533	0.03
USD	106,000	ONEMAIN FIN 6.75% 15/12/19 144A	106,305	108,262	0.03
USD	100,000	ACTIVISION BLIZ 6.125% 15/9/23 144A	108,750	108,186	0.03
USD	117,000	ROSETTA RESOURCES 5.625% 01/05/21	101,835	107,239	0.03
USD	100,000	CYRUSONE LP/FIN 6.375% 15/11/22	104,250	106,923	0.03
USD	105,000	DYNEGY FINANCE I 6.75% 1/11/19 144A	105,225	106,712	0.03
USD	100,000	WALGREENS BOOTS 4.8% 18/11/44	103,471	106,555	0.03
USD	100,000	INTL LEASE FIN 6.75% 01/09/16 144A	106,500	106,544	0.03
USD	100,000	TEMPUR SEALY INTL 6.875% 15/12/20	108,100	106,125	0.03
USD	100,000	UNITED RENTALS 6.125% 15/06/23	101,750	105,182	0.02
USD	100,000	HCA INC 5.25% 15/04/25	100,375	104,652	0.02
USD	100,000	NCR CORP 6.375% 15/12/23	105,250	104,207	0.02
USD	100,000	GCI INC 8.625% 15/11/19 WI	104,688	104,086	0.02
USD	150,000	SANDRIDGE ENERGY 8.75% 15/01/20	145,500	103,637	0.02
USD	100,000	SABINE PASS LNG 7.5% 30/11/16	108,500	103,038	0.02
USD	100,000	ADT CORP 6.25% 15/10/21	101,750	102,934	0.02
USD	100,000	UNITED CONTINENTAL 6% 01/12/20	103,625	102,662	0.02
USD	100,000	NAI ENTER HLDGS 5% 01/08/18 144A	103,250	102,325	0.02
USD	100,000	HCA INC 4.75% 01/05/23	98,000	101,730	0.02
USD	100,000	CCOH SAFARI 5.5% 01/12/22	100,000	101,700	0.02
USD	100,000	JEFFERIES GP LLC 6.5% 20/01/43	110,614	101,082	0.02
USD	100,000	LEVEL 3 COMM 5.75% 01/12/22 144A	100,107	100,813	0.02
USD	150,000	JC PENNEY CORP INC 6.375% 15/10/36	132,563	100,788	0.02
USD	100,000	WELLS FARGO&CO 3.3% 09/09/24 MTN	100,441	100,786	0.02
USD	100,000	AIR LEASE CORP 3.875% 01/04/21	101,875	100,680	0.02
USD	114,000	ROSETTA RESOURCES 5.875% 01/06/24	101,953	100,678	0.02
USD	150,000	SANDRIDGE ENERGY 8.125% 15/10/22	146,750	100,677	0.02
USD	100,000	STANDARD PACIFIC CO 5.875% 15/11/24	100,000	100,246	0.02
USD	100,000	FHLB 0.3% 04/01/16	99,998	100,036	0.02
USD	100,000	CATERPILLAR FIN 2.25% 01/12/19 MTN	99,920	99,985	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	100,000	SPRINGLEAF FINANCE 6% 01/06/20 WI	99,000	99,645	0.02
USD	100,000	SPRINT CORP 7.25% 15/09/21	99,500	99,420	0.02
USD	100,000	FELCOR LODGING LP 5.625% 01/03/23	100,190	99,204	0.02
USD	112,000	CALIFORNIA RES 5.5% 15/09/21 144A	104,313	97,617	0.02
USD	150,000	ENERGY XXI GULF 9.25% 15/12/17	150,375	97,586	0.02
USD	100,000	REYNOLDS AMERICAN 4.75% 01/11/42	95,421	96,577	0.02
USD	100,000	K HOVNANIAN ENT 7% 15/01/19 144A	100,000	95,595	0.02
USD	100,000	HARLAND CLARKE 9.25% 01/03/21 144A	102,750	94,767	0.02
USD	100,000	REGAL ENTERTAINMENT 5.75% 01/02/25	93,500	92,929	0.02
USD	90,000	TRANSDIGM INC 6% 15/07/22	91,773	89,944	0.02
USD	100,000	AK STEEL CORP 8.375% 01/04/22	95,375	89,655	0.02
USD	75,000	FIRST DATA CORP 11.75% 15/08/21	87,188	86,667	0.02
USD	100,000	COMPRESSCO PART 7.25% 15/08/22 144A	99,250	86,161	0.02
USD	80,000	K HOVNANIAN ENT 9.125% 15/11/20 144	86,800	86,092	0.02
USD	125,000	CHASSIX INC 9.25% 01/08/18 144A	77,406	84,459	0.02
USD	83,000	SEALED AIR CORP 5.125% 1/12/24 144A	83,000	83,630	0.02
USD	83,000	NAVIENT CORP 5% 26/10/20	82,473	81,575	0.02
USD	100,000	RUE21 INC 9% 15/10/21 144A	76,333	80,629	0.02
USD	79,000	AVIS BUDGET CAR 5.5% 01/04/23 144A	78,704	80,347	0.02
USD	75,000	MGM MIRAGE INC 7.5% 01/06/16	80,813	80,099	0.02
USD	150,000	MIDSTATES PETRO 10.75% 01/10/20	122,719	79,605	0.02
USD	75,000	KINDRED ESCROW 8.75% 15/01/23 144A	75,063	79,539	0.02
USD	75,000	CALPINE CORP 5.875% 15/01/24 144A	80,250	79,466	0.02
USD	75,000	CCO HLDGS LLC 8.125% 30/04/20	80,063	79,182	0.02
USD	75,000	NORTEK INC 10% 01/12/18	79,088	78,694	0.02
USD	75,000	VPI ESCROW CORP 6.375% 15/10/20 144	77,438	78,289	0.02
USD	75,000	SPRINT NEXTEL CORP 6% 01/12/16	79,313	78,214	0.02
USD	75,000	CHESAPEAKE ENERGY 5.75% 15/03/23	73,563	77,698	0.02
USD	75,000	BALL CORP 5% 15/03/22	77,813	77,496	0.02
USD	75,000	JBS USA LLC 7.25% 01/06/21 144A	80,719	77,360	0.02
USD	70,000	NRG ENERGY INC 7.625% 15/01/18	77,700	77,045	0.02
USD	75,000	DISH DBS 7.75% 31/05/15	77,906	76,925	0.02
USD	75,000	DAVITA HEALTHCARE 5.125% 15/07/24	74,953	76,867	0.02
USD	75,000	AMAZON.COM IN C 3.8% 05/12/24	74,729	76,722	0.02
USD	75,000	GREYSTAR REAL 8.25% 01/12/22 144A	75,000	76,636	0.02
USD	75,000	HALYARD HEALTH 6.25% 15/10/22 144A	75,531	76,269	0.02
USD	75,000	ECO SERVICES 8.5% 01/11/22 144A	75,000	76,254	0.02
USD	75,000	SPECTRUM BRANDS 6.125% 15/12/24 144	75,000	76,116	0.02
USD	75,000	EQUINIX INC 5.75% 01/01/25	75,000	75,931	0.02
USD	93,000	GENWORTH HDGS INC 4.9% 15/08/23	76,208	74,911	0.02
USD	75,000	EARTHLINK 8.875% 15/05/19	74,375	74,103	0.02
USD	75,000	REALOGY GROUP 5.25% 01/12/21 144A	75,000	72,979	0.02
USD	75,000	TARGA RESOURCES 4.125% 15/11/19 144	75,000	72,101	0.02
USD	75,000	WINDSTREAM CORP 6.375% 01/08/23	72,563	70,650	0.02
USD	75,000	PEABODY ENERGY 6% 15/11/18 WI	72,375	68,692	0.02
USD	75,000	BI-LO LLC 9.25% 15/02/19 144A	74,063	68,319	0.02
USD	75,000	LINN ENERGY LLC 8.625% 15/4/20	70,500	65,339	0.02
USD	75,000	APX GROUP INC 8.75% 01/12/20	68,063	64,218	0.02
USD	75,000	LINN ENERGY LLC/FIN 6.5% 15/5/19 WI	65,375	63,074	0.01
USD	75,000	TMX FIN LLC 8.5% 15/09/18 144A	78,750	61,558	0.01
USD	60,000	KINDER MORGAN 5.4% 01/09/44	56,314	60,172	0.01
USD	75,000	CAESARS ENTERT 9% 15/02/20	58,750	56,888	0.01
USD	50,000	BERRY PLASTICS CORP 9.75% 15/01/21	56,600	55,774	0.01
USD	50,000	INTL LEASE FIN CORP 7.125% 1/9/18 1	56,625	55,669	0.01
USD	50,000	FIRST DATA CORP 8.875% 15/8/20 144A	53,875	53,845	0.01
USD	50,000	GENERAL MOTORS CO 4.875% 02/10/33	53,500	53,531	0.01
USD	50,000	AMC NETWORKS INC 7.75% 15/07/21 WI	55,250	53,430	0.01
USD	50,000	KINDRED ESCROW 8% 15/01/20 144A	50,000	53,068	0.01
USD	50,000	JPMORGAN CHASE& CO 3.875% 01/02/24	52,096	52,259	0.01
USD	50,000	ACCURIDE CORP 9.5% 01/08/18	52,500	52,158	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	50,000	SABRA HEALTH 5.5% 01/02/21	49,750	52,078	0.01
USD	50,000	LANDRY'S HDGS II 10.25% 01/01/18 14	51,875	51,519	0.01
USD	50,000	WR GRACE & CO 5.125% 01/10/21 144A	50,000	51,345	0.01
USD	50,000	JPMORGAN CHASE&CO 3.625% 13/05/24	50,734	51,258	0.01
USD	50,000	T-MOBILE USA INC 6.375% 01/03/25	50,938	50,930	0.01
USD	50,000	DANA HOLDING CO 5.5% 15/12/24	50,000	50,873	0.01
USD	50,000	ENERGY TRASNFER EQ 5.875% 15/01/24	51,125	50,867	0.01
USD	50,000	MORGAN STANLEY 3.7% 23/10/24	50,185	50,720	0.01
USD	50,000	MERCER INTL 7.75% 01/12/22 144A	50,000	50,717	0.01
USD	50,000	ANNA MERGER SUB 7.75% 01/10/22 144A	50,000	50,715	0.01
USD	50,000	FRESENIUS MED 4.75% 15/10/24 144A	50,125	50,631	0.01
USD	50,000	MERCER INTL 7% 01/12/19 144A	50,000	50,564	0.01
USD	50,000	MEDIACOM LLC/CORP 5.5% 15/04/21	50,750	50,330	0.01
USD	50,000	MULTI-COLOR 6.125% 01/12/22 144A	50,000	50,096	0.01
USD	50,000	SEALED AIR CORP 4.875% 1/12/22 144A	50,000	49,731	0.01
USD	50,000	DR HORTON INC 3.75% 01/03/19	50,125	49,679	0.01
USD	50,000	INTERACTIVE DATA 5.875% 15/4/19 144	50,188	49,625	0.01
USD	50,000	AMERICAN GILSONITE 11.5% 1/09/17 14	54,313	49,277	0.01
USD	50,000	HUNTSMAN INTL 5.125% 15/11/22 144A	50,000	49,228	0.01
USD	50,000	VERISIGN INC 4.625% 01/05/23	49,000	49,107	0.01
USD	50,000	NAVISTAR INTL CORP 8.25% 01/11/21	51,875	49,079	0.01
USD	50,000	SANCHEZ ENERY CORP 7.75% 15/6/21	44,500	47,326	0.01
USD	50,000	RESOLUTE FOREST 5.875% 15/05/23	48,250	47,226	0.01
USD	45,000	SCIENTIFIC GAMES INTL 7% 1/1/22 144	45,000	45,754	0.01
USD	43,000	TESORO LOGISTICS 6.25% 15/10/22 144	43,000	43,297	0.01
USD	75,000	ARCH COAL INC 8% 15/01/19 144A	51,375	42,988	0.01
USD	50,000	HALCON RESOURCES 9.75% 15/07/20	36,313	38,051	0.01
USD	50,000	CONN'S INC 7.25% 15/07/22 144A	44,438	37,568	0.01
USD	75,000	ALPHA NATURAL RES 9.75% 15/04/18	52,875	34,875	0.01
USD	39,000	ROSETTA RESOURCES 5.875% 01/06/22	35,824	34,777	0.01
USD	50,000	SUNGARD AVAIL 8.75% 01/04/22 144A	34,875	29,547	0.01
USD	40,000	PUERTO RICO CMWLTH 6% 01/07/44	29,600	28,308	0.01
USD	25,000	MGM RESORTS INTL 10% 01/11/16 144A	28,406	27,946	0.01
USD	25,000	SUMMIT MAT LLC/FIN 10.5% 31/01/20	27,500	27,763	0.01
USD	25,000	CALPINE CORP 7.875% 15/01/23 144A	27,125	27,581	0.01
USD	25,000	21ST CENTURY FOX 4.75% 15/09/44 144	26,253	27,344	0.01
USD	25,000	RITE AID CORP 7.7% 15/02/27	27,375	27,320	0.01
USD	25,000	NBC UNIVERSAL 4.45% 15/01/43	25,727	26,521	0.01
USD	25,000	GENERAL MOTORS 4.375% 25/09/21	26,375	26,143	0.01
USD	25,000	HEALTHSOUTH CORP 5.75% 01/11/24	25,906	26,113	0.01
USD	25,000	WALGREENS BOOTS 4.5% 18/11/34	25,249	26,056	0.01
USD	25,000	PINNACLE ENTER 7.75% 01/04/22	27,313	26,041	0.01
USD	25,000	WHITEWAVE FOODS 5.375% 01/10/22	25,000	25,866	0.01
USD	25,000	AECOM TECH 5.75% 15/10/22 144A	25,000	25,799	0.01
USD	25,000	MPG HOLDCO 1 7.375% 15/10/22 144A	25,000	25,796	0.01
USD	25,000	RCN TELE SER CAP 8.5% 15/08/20 144A	25,500	25,784	0.01
USD	25,000	IMS HEALTH INC 6% 01/11/20 144A	25,969	25,781	0.01
USD	25,000	BECTON DICKISON 3.734% 15/12/24	25,000	25,740	0.01
USD	25,000	AMSURG CORP 5.625% 30/11/20	25,813	25,723	0.01
USD	25,000	21ST CENTURY FOX 3.7% 15/09/24 144A	25,632	25,716	0.01
USD	25,000	VERIZON COMM 4.862% 21/08/46 144A	25,696	25,708	0.01
USD	25,000	GENERAL MOTORS CO 5% 01/04/35	24,690	25,680	0.01
USD	25,000	AVAYA INC 9% 01/04/19 144A	25,500	25,581	0.01
USD	25,000	JAC HOLDING 11.5% 01/10/19 144A	25,000	25,529	0.01
USD	25,000	OMNICARE INC 5% 01/12/24	25,000	25,505	0.01
USD	25,000	HARBINGER GROUP 7.75% 15/01/22 144a	25,000	25,291	0.01
USD	25,000	FRONTIER COMM 6.25% 15/09/21	25,000	25,232	0.01
USD	25,000	GRAPHIC PACK 4.875% 15/11/22	25,000	25,178	0.01
USD	25,000	RANGE RESOURCES CORP 5% 15/03/23	25,000	25,177	0.01
USD	25,000	CONSOLID COMM 6.5% 01/10/22 144	25,000	25,110	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	ANIXTER INC 5.125% 01/10/21	25,000	25,046	0.01
USD	25,000	HUNTSMANN INTL 4.875% 15/11/20	24,750	24,978	0.01
USD	25,000	GENON ENERGY 9.875% 15/10/20 WI	26,000	24,909	0.01
USD	25,000	TESORO LOGISTICS 5.5% 15/10/19 144A	25,000	24,845	0.01
USD	25,000	GANNETT CO 4.875% 15/09/21 144A	24,633	24,796	0.01
USD	25,000	CARDTRONICS INC 5.125% 01/08/22 144	24,563	24,424	0.01
USD	25,000	TPC GROUP INC 8.75% 15/12/20 144A	25,875	24,348	0.01
USD	25,000	BLUE RACER MID 6.125% 15/11/22 144A	24,613	24,298	0.01
USD	25,000	CEQUEL COM HLD 5.125% 15/12/21 144A	24,313	24,233	0.01
USD	25,000	BMC SOFTWARE 7.25% 01/06/18	24,500	24,206	0.01
USD	75,000	ALPHA NATURAL RES 6% 01/06/19	36,000	23,658	0.01
USD	25,000	PENN NTL GAMING 5.875% 01/11/21	24,063	23,480	0.01
USD	25,000	AK STEEL CORP 7.625% 01/10/21	24,831	22,789	0.01
USD	25,000	HECLA MINING CO 6.875% 01/05/21	23,469	22,036	0.01
USD	50,000	COLT DEFENSE/FIN 8.75% 15/11/17	32,000	20,274	0.00
USD	25,000	MAGNUM HUNTER 9.75% 15/05/20	25,125	19,526	0.00
USD	25,000	CAESARS ENTERT 8.5% 15/02/20	19,250	19,151	0.00
USD	25,000	ACE CASH EXPRESS 11% 01/02/19 144A	17,469	17,643	0.00
USD	50,000	NII CAPITAL CORP 10% 15/08/16	10,438	17,285	0.00
USD	25,000	SANDRIDGE ENERGY 7.5% 15/03/21	22,375	16,526	0.00
USD	25,000	GYMBOREE CORP 9.125% 01/12/18	9,250	9,636	0.00
USD	25,000	ARCH COAL INC 7.25% 15/06/21	9,750	7,886	0.00
USD	10,000	PUERTO RICO AQUE&SE 5.125% 01/07/37	7,125	6,713	0.00
USD	25,000	NII CAPITAL CORP 7.625% 01/04/21	4,172	4,631	0.00
USD	2,000	HALCON RES CORP 9.25% 15/02/22	1,485	1,462	0.00
			128,515,850	125,778,905	29.72
TBA取引					
USD	3,770,000	FNCL 30YR TBA 4% 14/01/15 REG A	4,007,595	4,023,297	0.95
USD	3,325,000	FNCL 30YR TBA 4.5% 14/01/15 REG A	3,601,714	3,609,703	0.85
USD	1,745,000	FGLMC 30YR TBA 4% 14/01/15 REG A	1,852,751	1,860,061	0.44
USD	1,390,000	FGLMC 30YR TBA 4.5% 14/01/15 REG A	1,503,920	1,506,847	0.36
USD	435,000	FNCL 30YR TBA 5% 14/01/15 REG A	481,559	480,675	0.11
			11,447,539	11,480,583	2.71
短期国庫債券					
USD	2,500,000	US TREAS BILL 0% 19/03/15	2,499,631	2,501,553	0.59
USD	2,500,000	US TREAS BILL 0% 17/09/15	2,497,445	2,498,925	0.59
			4,997,076	5,000,478	1.18
優先証券					
--	26,925	GMAC CAP TST I PFD FRN 15/02/40	714,964	708,396	0.17
--	6,500	ALLY FINANCIAL PFD FRN 31/12/49	171,925	173,420	0.04
--	2,618	MORGAN STANLEY PFD FRN 31/12/49 I	65,450	66,000	0.02
--	733	COWEN GROUP PFD 8.25% 15/10/21	18,325	18,875	0.00
			970,664	966,691	0.23
国債					
USD	1,932,000	US TREAS NOTE 3.125% 15/08/44	1,910,131	2,081,427	0.50
USD	2,000,000	US TREAS NOTE 2.25% 31/01/15	2,008,178	2,003,750	0.47
USD	2,000,000	US TREAS NOTE 0.25% 15/01/15	2,001,413	2,000,000	0.47
USD	2,000,000	US TREAS NOTE 1.625% 31/12/19	1,989,127	1,995,000	0.47
USD	1,500,000	US TREAS NOTE 2.125% 31/12/21	1,500,000	1,513,828	0.36
USD	1,500,000	US TREAS NOTE 1.5% 30/11/19	1,493,181	1,488,750	0.35
USD	785,000	US TREAS NOTE 2% 15/01/26 (CPI)	1,112,906	1,074,610	0.25
USD	1,000,000	US TREAS NOTE 2% 31/10/21	998,830	1,001,719	0.24
USD	800,000	US TREAS NOTE 3% 15/11/44	814,683	841,250	0.20
USD	625,000	US TREAS NOTE 2.75% 15/02/24	659,766	657,227	0.16
USD	285,000	US TREAS NOTE 3.875% 15/04/29 (CPI)	593,115	590,745	0.14
USD	25,000	US TREAS NOTE 5.5% 15/08/28	34,027	34,152	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	15,000	US TREAS NOTE 3.875% 15/08/40	18,009	18,338	0.00
			15,133,366	15,300,796	3.62
		合計: アメリカ	324,594,467	320,463,810	75.75
		ベネズエラ			
国債					
USD	60,000	REP OF BENEZUELA 9.25% 7/5/28	30,393	26,742	0.01
USD	60,000	REP OF BENEZUELA 7.65% 21/04/25	25,665	25,785	0.01
USD	30,000	BOL REP OF VZLA 8.25% 13/10/24 REGS	15,965	13,222	0.00
USD	20,000	REP OF BENEZUELA 7% 31/03/38	9,480	8,296	0.00
USD	10,000	REP OF BENEZUELA 9% 07/05/23	5,750	4,442	0.00
			87,253	78,487	0.02
その他債券					
USD	100,000	PETROLEOS VENEZ 6% 16/05/24 REGS	40,557	38,222	0.01
USD	50,000	PETROLEOS VENEZU 6% 15/11/26 REGS	23,212	18,661	0.00
			63,769	56,883	0.01
普通社債(固定金利債)					
USD	50,000	PETROLEONS VENEZUELA 5.375% 12/04/27	18,950	17,787	0.01
USD	10,000	PETROLEOS DE VEN 5.5% 12/04/37	4,475	3,532	0.00
			23,425	21,319	0.01
		合計: ベネズエラ	174,447	156,689	0.04
		組入資産合計	400,614,340	395,231,449	93.43

⁽¹⁾ 額面価格は発行通貨建て表示

財務書類に関する注記

2014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

2014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)
INR	329,000,000	USD	5,287,264	2015年1月23日	(136,779)
INR	330,000,000	USD	5,309,948	2015年1月23日	(143,808)
TRY	8,100,000	USD	3,540,984	2015年1月23日	(68,473)
ZAR	40,000,000	USD	3,521,880	2015年1月23日	(93,984)
MXN	201,500,000	USD	14,834,283	2015年1月23日	(1,201,939)
INR	330,000,000	USD	5,304,613	2015年1月23日	(138,473)
ZAR	40,000,000	USD	3,522,584	2015年1月23日	(94,688)
TRY	8,100,000	USD	3,528,643	2015年1月23日	(56,132)
TRY	8,100,000	USD	3,546,099	2015年1月23日	(73,588)
ZAR	39,500,000	USD	3,490,417	2015年1月23日	(105,369)
INR	337,000,000	USD	5,428,042	2015年1月23日	(152,317)
BRL	87,100,000	USD	33,076,117	2015年1月5日	(898,297)
BRL	3,900,000	USD	1,528,932	2015年1月5日	(88,134)
TRY	10,400,000	USD	4,634,998	2015年1月23日	(176,466)
TRY	12,700,000	USD	5,671,413	2015年1月23日	(226,859)
JPY	736,790,704	USD	6,179,912	2015年1月13日	(12,948)
JPY	709,469	USD	5,945	2015年1月13日	(7)
INR	490,000,000	USD	7,827,476	2015年2月20日	(197,656)
TRY	11,000,000	USD	4,758,197	2015年2月20日	(69,450)
ZAR	58,000,000	USD	5,001,552	2015年2月20日	(53,071)
INR	490,000,000	USD	7,831,667	2015年2月20日	(201,847)
TRY	11,000,000	USD	4,794,282	2015年2月20日	(105,535)
ZAR	18,400,000	USD	1,583,572	2015年1月23日	(6,740)
TRY	3,300,000	USD	1,444,859	2015年1月23日	(30,132)
ZAR	58,000,000	USD	4,989,462	2015年2月20日	(40,981)
BRL	4,300,000	USD	1,643,260	2015年1月5日	(54,688)
MXN	27,000,000	USD	1,872,480	2015年1月23日	(45,814)
ZAR	58,900,000	USD	5,064,445	2015年2月20日	(39,177)
TRY	10,200,000	USD	4,434,011	2015年2月20日	(86,264)
INR	480,000,000	USD	7,665,283	2015年2月20日	(191,174)
MXN	298,000,000	USD	20,530,486	2015年2月20日	(405,632)
JPY	737,441,896	USD	6,235,552	2015年1月23日	(62,556)
USD	22,071	JPY	2,613,553	2015年1月13日	196
JPY	134,926	USD	1,139	2015年1月13日	(10)
USD	22,071	JPY	2,613,354	2015年1月23日	195
JPY	134,916	USD	1,139	2015年1月23日	(10)
INR	106,000,000	USD	1,685,483	2015年1月23日	(26,056)
MXN	23,000,000	USD	1,554,359	2015年1月23日	1,691
TRY	3,300,000	USD	1,386,188	2015年1月23日	28,539
BRL	4,000,000	USD	1,445,870	2015年1月5日	31,871
USD	52,939	JPY	6,167,133	2015年1月13日	1,320
USD	52,939	JPY	6,166,630	2015年1月23日	1,319
ZAR	16,600,000	USD	1,407,298	2015年1月23日	15,279
BRL	99,300,000	USD	35,875,574	2015年2月3日	543,622
USD	36,201,240	BRL	99,300,000	2015年1月5日	(483,692)
JPY	1,559,409	USD	13,153	2015年1月13日	(101)
JPY	1,559,304	USD	13,153	2015年1月23日	(101)
INR	90,000,000	USD	1,418,775	2015年1月23日	(9,828)

購入通貨	購入金額	売却通貨	売却金額	満期日	未実現損益 (米ドル)
BRL	3,800,000	USD	1,417,382	2015年2月3日	(23,696)
USD	137,635	JPY	16,432,381	2015年1月13日	95
USD	137,635	JPY	16,431,417	2015年1月23日	91
TRY	2,600,000	USD	1,113,843	2015年1月23日	790
JPY	454,951	USD	3,799	2015年1月13日	9
JPY	454,915	USD	3,799	2015年1月23日	9
USD	14,727	JPY	1,773,002	2015年1月23日	(115)
USD	21,473	JPY	2,585,182	2015年1月23日	(167)
USD	14,727	JPY	1,773,134	2015年1月13日	(115)
USD	21,473	JPY	2,585,376	2015年1月13日	(167)
CLP	481,344,000	USD	800,000	2015年1月20日	(10,432)
BRL	7,035,690	USD	2,784,207	2015年1月5日	(184,974)
USD	1,698,218	KRW	1,900,000,000	2015年1月22日	(34,347)
MYR	1,900,000	USD	550,358	2015年1月22日	(8,420)
INR	105,000,000	USD	1,677,852	2015年1月22日	(33,713)
PHP	12,900,000	USD	286,349	2015年1月22日	1,405
PLN	4,500,000	USD	1,340,985	2015年1月22日	(69,656)
AUD	1,000,000	USD	844,466	2015年1月22日	(29,491)
HUF	260,000,000	USD	1,053,331	2015年1月22日	(49,937)
ZAR	14,300,000	USD	1,286,432	2015年1月22日	(60,762)
USD	456,248	CZK	10,100,000	2015年1月22日	12,324
USD	19,903,568	EUR	16,000,000	2015年1月22日	418,770
USD	1,766,475	ILS	7,000,000	2015年1月22日	(23,904)
USD	6,241,483	JPY	742,000,000	2015年1月22日	30,383
USD	4,545,408	CHF	4,400,000	2015年1月22日	89,247
CNY	6,200,000	USD	1,002,667	2015年1月22日	(5,982)
USD	471,223	GBP	300,000	2015年1月22日	5,076
USD	4,201,826	SEK	31,300,000	2015年1月22日	200,975
USD	2,287,808	CAD	2,600,000	2015年1月22日	52,890
USD	7,803,330	NZD	10,000,000	2015年1月22日	(6,469)
NOK	26,200,000	USD	3,739,734	2015年1月22日	(222,346)
USD	770,532	MXN	10,900,000	2015年1月22日	33,054
MXN	10,900,000	USD	769,484	2015年1月22日	(32,006)
NZD	2,300,000	USD	1,778,383	2015年1月22日	17,871
NZD	1,100,000	USD	836,790	2015年1月22日	22,288
CAD	1,545,631	USD	1,345,000	2015年1月22日	(16,400)
NOK	10,000,000	USD	1,397,875	2015年1月22日	(55,361)
USD	1,371,791	SEK	10,300,000	2015年1月22日	55,217
USD	251,606	CZK	5,567,500	2015年1月22日	6,899
ZAR	5,780,220	USD	499,339	2015年1月22日	(3,910)
IDR	3,108,000,000	USD	250,000	2015年1月15日	(1,047)
USD	993,161	CNY	6,182,415	2015年1月22日	(698)
USD	220,000	JPY	25,946,470	2015年1月22日	2,808
SEK	29,250,000	USD	3,890,831	2015年1月22日	(152,017)
USD	3,858,540	NOK	27,660,000	2015年1月22日	145,145
AUD	1,000,000	NZD	1,061,386	2015年1月22日	(13,946)
EUR	1,000,000	GBP	791,648	2015年1月22日	(12,280)
IDR	6,216,500,000	USD	500,000	2015年1月15日	(2,053)
USD	217,786	KRW	240,000,000	2015年1月22日	(1,064)
EUR	1,100,000	USD	1,369,844	2015年1月22日	(30,264)
USD	2,636,621	BRL	7,035,690	2015年1月5日	37,388
BRL	7,035,690	USD	2,614,235	2015年2月3日	(33,830)
USD	178,764	ILS	700,000	2015年1月22日	(274)
USD	182,025	KRW	200,000,000	2015年1月22日	(350)
HUF	63,280,940	EUR	200,000	2015年1月22日	654
ZAR	5,500,000	USD	473,291	2015年1月22日	(1,880)
USD	470,000	CAD	544,977	2015年1月22日	1,547
PLN	853,310	EUR	200,000	2015年1月22日	(2,485)
INR	11,900,000	USD	187,078	2015年1月22日	(742)
USD	180,000	JPY	21,559,608	2015年1月22日	(470)
USD	180,000	CHF	176,518	2015年1月22日	1,229

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	269,154	EUR	220,000	2015年1月22日	1,238
NZD	700,000	USD	540,504	2015年1月22日	6,182
USD	615,468	SEK	4,800,000	2015年1月22日	1,919
USD	143,756	MXN	1,943,000	2015年1月29日	12,340
USD	47,290	PHP	2,132,662	2015年1月12日	(309)
INR	24,755,000	USD	398,150	2015年1月15日	(9,921)
USD	180,031	MXN	2,452,164	2015年2月19日	14,418
NZD	42,376	USD	33,183	2015年1月8日	(41)
AUD	311,069	USD	265,746	2015年3月18日	(13,214)
USD	198,592	NZD	255,364	2015年3月18日	225
USD	140,609	SGD	182,486	2015年3月18日	2,832
INR	8,394,530	USD	135,000	2015年1月27日	(3,691)
NOK	933,000	USD	136,885	2015年3月18日	(11,830)
USD	131,788	SGD	171,256	2015年3月18日	2,489
HUF	45,111,330	USD	183,000	2015年3月18日	(9,155)
CAD	382,757	USD	339,534	2015年3月18日	(10,923)
USD	159,175	BRL	409,000	2015年1月16日	8,500
TRY	513,596	USD	225,000	2015年3月18日	(7,314)
USD	209,419	NZD	268,132	2015年3月18日	1,134
CAD	380,953	USD	337,668	2015年3月18日	(10,605)
CAD	155,098	USD	137,000	2015年3月18日	(3,843)
USD	265,622	AUD	311,069	2015年3月18日	13,090
USD	250,000	CNH	1,550,718	2015年3月18日	2,591
CLP	81,542,000	USD	136,770	2015年1月9日	(2,929)
USD	271,573	AUD	320,000	2015年3月18日	11,790
GBP	176,000	USD	275,542	2015年3月18日	(2,188)
RUB	3,131,400	USD	68,000	2015年1月26日	(14,518)
TRY	299,328	USD	131,399	2015年3月18日	(4,530)
USD	191,715	NZD	248,980	2015年3月18日	(1,693)
ZAR	875,456	USD	78,185	2015年3月18日	(3,820)
GBP	50,502	USD	79,165	2015年1月9日	(686)
USD	828,135	GBP	528,294	2015年1月9日	7,177
USD	80,428	CHF	77,521	2015年3月18日	1,828
USD	46,351	INR	2,890,000	2015年1月15日	1,028
USD	274,000	CNH	1,701,537	2015年3月18日	2,528
USD	131,279	SGD	171,224	2015年3月18日	2,004
HUF	29,112,722	USD	118,215	2015年3月18日	(6,023)
TRY	314,986	USD	138,584	2015年3月18日	(5,078)
USD	62,868	PHP	2,830,023	2015年1月13日	(291)
USD	139,427	PLN	470,000	2015年3月18日	6,949
USD	235,296	NZD	304,000	2015年3月18日	(851)
NZD	178,000	USD	138,021	2015年3月18日	249
USD	197,769	GBP	125,988	2015年1月9日	1,987
USD	70,000	JPY	8,204,371	2015年3月18日	1,288
USD	48,000	TRY	108,641	2015年3月18日	1,953
USD	139,000	CNH	862,558	2015年3月18日	1,383
USD	279,000	CNH	1,733,293	2015年3月18日	2,462
ZAR	675,004	USD	60,427	2015年3月18日	(3,090)
USD	267,000	CNH	1,656,922	2015年3月18日	2,647
USD	31,000	CAD	35,003	2015年3月18日	949
EUR	111,500	USD	139,323	2015年3月18日	(3,475)
GBP	59,604	USD	93,835	2015年1月9日	(1,211)
USD	106,890	EUR	85,883	2015年3月18日	2,253
HUF	29,051,097	USD	117,137	2015年3月18日	(5,183)
USD	282,000	CAD	321,584	2015年3月18日	5,908
INR	8,813,910	USD	141,000	2015年1月27日	(3,131)
EUR	113,000	NOK	989,620	2015年3月18日	5,032
USD	93,160	BRL	241,000	2015年1月13日	4,308
USD	141,000	CAD	161,589	2015年3月18日	2,270
USD	103,000	COP	227,511,859	2015年1月9日	7,570
EUR	113,000	NOK	985,371	2015年3月18日	5,601

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	8,414,245	USD	71,000	2015年3月18日	(531)
USD	36,600	CLP	22,324,170	2015年1月9日	(42)
USD	142,000	CAD	162,452	2015年3月18日	2,529
USD	143,000	MYR	492,196	2015年1月9日	2,442
USD	537,000	CHF	519,037	2015年3月18日	10,738
USD	209,974	CNH	1,304,357	2015年3月18日	1,870
USD	71,405	AUD	85,000	2015年3月18日	2,400
USD	385,436	EUR	309,320	2015年3月18日	8,571
USD	282,000	CAD	322,157	2015年3月18日	5,416
USD	253,000	CNH	1,572,775	2015年3月18日	2,072
JPY	33,911,776	USD	287,000	2015年3月18日	(2,989)
PLN	479,859	USD	143,000	2015年3月18日	(7,743)
JPY	16,865,420	USD	143,000	2015年3月18日	(1,752)
USD	86,257	AUD	103,000	2015年3月18日	2,640
NZD	182,000	USD	142,299	2015年3月18日	(922)
USD	287,000	CAD	326,767	2015年3月18日	6,458
USD	336,976	CHF	325,518	2015年3月18日	6,926
USD	287,000	JPY	34,076,371	2015年3月18日	1,611
USD	204,315	CNH	1,268,942	2015年3月18日	1,862
USD	143,000	JPY	16,983,536	2015年3月18日	763
USD	66,000	RUB	3,550,800	2015年1月26日	5,355
USD	286,000	JPY	33,974,512	2015年3月18日	1,464
TRY	292,540	USD	128,799	2015年3月18日	(4,807)
USD	72,500	BRL	188,523	2015年1月16日	3,048
USD	23,760	COP	53,201,016	2015年1月9日	1,445
MXN	1,819,719	USD	129,097	2015年3月18日	(6,419)
USD	472,573	CHF	457,918	2015年3月18日	8,281
USD	29,000	MYR	99,710	2015年1月9日	525
EUR	116,000	USD	143,890	2015年3月18日	(2,560)
COP	166,439,555	USD	72,500	2015年1月9日	(2,687)
EUR	116,000	USD	143,469	2015年3月18日	(2,138)
TRY	286,038	USD	125,071	2015年3月18日	(3,835)
USD	82,877	ZAR	934,963	2015年3月18日	3,457
USD	436,957	CHF	425,567	2015年3月18日	5,466
USD	32,018	JPY	3,821,000	2015年1月15日	36
USD	203,190	CNH	1,262,218	2015年3月18日	1,810
COP	66,482,500	USD	29,000	2015年1月9日	(1,114)
GBP	183,750	EUR	233,000	2015年3月18日	1,511
USD	43,000	MYR	148,631	2015年1月9日	555
USD	121,550	BRL	313,418	2015年1月9日	5,881
USD	177,464	BRL	457,920	2015年1月9日	8,465
USD	142,182	NZD	185,000	2015年3月18日	(1,526)
USD	708,275	EUR	574,553	2015年3月18日	8,259
JPY	17,362,517	USD	145,000	2015年3月18日	411
USD	73,000	ZAR	831,069	2015年3月18日	2,405
USD	474,390	CHF	463,000	2015年3月18日	4,946
EUR	97,000	USD	119,600	2015年3月18日	(1,419)
USD	288,253	AUD	347,000	2015年3月18日	6,551
PLN	493,550	EUR	118,000	2015年3月18日	(4,651)
USD	146,212	EUR	118,000	2015年3月18日	2,445
USD	71,364	MYR	248,629	2015年1月9日	362
USD	65,709	MYR	229,105	2015年1月9日	283
USD	125,689	BRL	328,188	2015年1月15日	4,755
USD	840,421	MXN	11,872,540	2015年1月20日	37,073
JPY	8,795,186	USD	73,000	2015年3月18日	660
USD	73,000	KRW	81,438,800	2015年1月9日	(1,315)
USD	146,000	TRY	336,165	2015年3月18日	3,518
USD	73,000	ZAR	839,685	2015年3月18日	1,673
USD	111,916	COP	258,928,000	2015年1月9日	3,308
USD	145,000	CAD	166,458	2015年3月18日	2,090
USD	85,076	BRL	223,674	2015年1月15日	2,654

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	44,311	MYR	154,664	2015年1月9日	143
USD	4,970,995	EUR	4,022,410	2015年1月28日	72,194
USD	519,087	EUR	420,032	2015年1月28日	7,539
USD	290,078	EUR	236,000	2015年3月18日	2,544
EUR	85,883	USD	105,782	2015年3月18日	(1,145)
NOK	522,970	EUR	59,000	2015年3月18日	(1,787)
JPY	8,839,679	USD	73,000	2015年3月18日	1,032
USD	73,000	BRL	191,099	2015年1月9日	2,473
USD	133,000	MXN	1,909,415	2015年3月18日	4,275
USD	146,000	TRY	339,231	2015年3月18日	2,218
USD	73,000	CAD	83,642	2015年3月18日	1,190
USD	348,000	CNH	2,173,879	2015年3月18日	1,169
USD	289,528	NZD	383,000	2015年3月18日	(7,986)
JPY	35,542,407	EUR	239,000	2015年3月18日	6,478
GBP	187,927	EUR	239,000	2015年3月18日	689
EUR	150,653	USD	184,928	2015年1月28日	(1,451)
EUR	59,500	JPY	8,824,593	2015年3月18日	(1,413)
EUR	237,000	USD	292,675	2015年3月18日	(3,922)
USD	73,000	ZAR	851,238	2015年3月18日	692
EUR	237,000	USD	292,574	2015年3月18日	(3,822)
EUR	119,000	JPY	17,620,972	2015年3月18日	(2,590)
USD	73,000	BRL	191,625	2015年1月13日	2,351
USD	610,416	MXN	8,808,918	2015年1月20日	14,367
USD	146,000	JPY	17,394,623	2015年3月18日	320
USD	146,380	EUR	118,000	2015年3月18日	2,613
USD	146,000	JPY	17,408,018	2015年3月18日	208
COP	103,825,260	USD	44,000	2015年1月9日	(451)
USD	73,000	ZAR	848,245	2015年3月18日	946
CNH	457,279	USD	73,000	2015年3月18日	(44)
USD	123,840	EUR	100,000	2015年1月28日	2,052
USD	143,657	NZD	188,000	2015年3月18日	(2,381)
ZAR	850,302	USD	72,500	2015年3月18日	(272)
USD	72,500	BRL	190,701	2015年1月12日	2,174
USD	145,500	JPY	17,236,221	2015年3月18日	1,147
USD	73,658	EUR	59,000	2015年3月18日	1,774
USD	146,000	JPY	17,226,321	2015年3月18日	1,730
NOK	534,735	EUR	59,000	2015年3月18日	(210)
EUR	59,000	USD	73,373	2015年3月18日	(1,489)
USD	184,178	EUR	148,000	2015年3月18日	3,860
NZD	187,000	USD	144,579	2015年3月18日	683
JPY	17,310,198	USD	146,000	2015年3月18日	(1,027)
USD	73,000	KRW	80,519,000	2015年1月15日	(452)
NZD	154,000	USD	119,104	2015年3月18日	524
CNH	1,371,428	USD	219,000	2015年3月18日	(196)
CAD	334,969	USD	291,000	2015年3月18日	(3,417)
USD	317,922	EUR	256,567	2015年1月28日	5,455
USD	73,000	BRL	194,231	2015年1月15日	1,427
USD	73,000	KRW	80,628,500	2015年1月15日	(552)
USD	95,784	GBP	61,009	2015年1月9日	977
AUD	145,000	USD	119,346	2015年3月18日	(1,632)
USD	74,000	IDR	930,920,000	2015年1月16日	(557)
USD	280,279	EUR	225,206	2015年1月28日	6,006
ZAR	878,306	USD	74,000	2015年3月18日	607
USD	539,730	MXN	8,006,901	2015年1月20日	(2,051)
MXN	2,176,595	USD	147,250	2015年3月18日	(513)
BRL	1,579,415	USD	589,000	2015年1月16日	(7,146)
NZD	188,500	USD	145,974	2015年3月18日	452
USD	292,522	AUD	358,000	2015年3月18日	1,891
USD	525,005	EUR	422,134	2015年1月28日	10,897
MXN	2,183,719	USD	147,000	2015年3月18日	217
CAD	171,332	USD	147,000	2015年3月18日	95

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	90,000	TRY	218,192	2015年3月18日	(2,480)
EUR	237,000	USD	295,328	2015年3月18日	(6,576)
BRL	397,973	USD	147,000	2015年1月15日	(350)
USD	74,000	IDR	952,224,600	2015年1月20日	(2,208)
EUR	50,426	USD	62,737	2015年1月28日	(1,325)
USD	295,000	JPY	34,306,287	2015年3月18日	7,685
USD	74,000	IDR	944,906,000	2015年1月20日	(1,623)
RUB	14,068,253	USD	220,500	2015年1月20日	20,707
MXN	1,094,149	USD	74,000	2015年3月18日	(237)
EUR	118,000	USD	146,984	2015年3月18日	(3,217)
USD	185,797	EUR	148,000	2015年3月18日	5,479
BRL	202,812	USD	74,000	2015年1月9日	849
CNH	1,740,027	USD	278,000	2015年3月18日	(388)
CAD	171,138	USD	147,000	2015年3月18日	(71)
USD	147,639	EUR	118,000	2015年3月18日	3,872
BRL	204,832	USD	74,000	2015年1月9日	1,595
NOK	2,214,839	EUR	236,000	2015年3月18日	9,331
NOK	565,460	EUR	59,000	2015年3月18日	3,908
USD	121,212	EUR	96,818	2015年1月28日	3,299
IDR	970,968,800	USD	74,000	2015年1月20日	3,709
USD	148,000	TRY	357,590	2015年3月18日	(3,563)
JPY	17,245,231	USD	147,000	2015年3月18日	(2,571)
ZAR	877,011	USD	74,000	2015年3月18日	497
BRL	403,668	USD	147,000	2015年1月9日	1,977
EUR	59,000	NOK	553,520	2015年3月18日	(2,307)
MYR	259,617	USD	74,000	2015年1月20日	64
MYR	259,650	USD	74,000	2015年1月20日	74
MYR	514,654	USD	147,000	2015年1月20日	(178)
USD	156,473	CHF	149,855	2015年2月10日	4,650
CHF	38,495	USD	40,000	2015年3月18日	(969)
IDR	778,971,360	USD	59,200	2015年1月20日	3,143
USD	262,655	MXN	3,890,473	2015年3月18日	376
USD	415,282	EUR	333,163	2015年1月28日	9,531
EUR	116,000	HUF	36,507,056	2015年3月18日	644
USD	27,819	SEK	212,219	2015年2月12日	690
JPY	17,024,885	USD	145,000	2015年3月18日	(2,417)
MXN	4,076,370	USD	278,720	2015年3月18日	(3,909)
USD	72,000	MXN	1,057,068	2015年3月18日	737
USD	72,000	BRL	196,272	2015年1月16日	(306)
USD	58,000	IDR	747,393,800	2015年1月20日	(1,815)
EUR	59,000	NOK	539,921	2015年3月18日	(485)
USD	144,360	EUR	117,000	2015年3月18日	1,812
USD	362,000	CHF	354,891	2015年3月18日	2,169
USD	289,000	SGD	380,022	2015年3月18日	2,082
AUD	162,000	USD	131,470	2015年3月18日	45
NZD	187,000	USD	143,466	2015年3月18日	1,795
CNH	2,724,452	USD	433,500	2015年3月18日	1,172
EUR	117,000	PLN	497,342	2015年3月18日	2,364
USD	325,974	EUR	265,348	2015年1月28日	2,812
USD	396,134	MXN	5,775,240	2015年2月19日	6,090
EUR	60,000	NOK	546,243	2015年3月18日	(114)
USD	74,000	BRL	198,039	2015年1月16日	1,043
USD	68,000	RUB	4,369,000	2015年1月20日	(6,909)
JPY	17,556,056	USD	148,000	2015年3月18日	(968)
JPY	17,619,651	USD	148,000	2015年3月18日	(436)
GBP	189,306	EUR	241,000	2015年3月18日	394
EUR	31,625	HUF	9,944,829	2015年3月18日	207
EUR	30,000	HUF	9,436,050	2015年3月18日	187
USD	74,000	BRL	197,765	2015年1月23日	1,274
EUR	242,000	USD	296,131	2015年3月18日	(1,286)
USD	59,000	RUB	3,452,267	2015年1月20日	(191)

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)
CNH	279,846	USD	44,475	2015年3月18日	173
USD	405,167	GBP	261,000	2015年3月18日	(205)
CNH	971,674	USD	154,617	2015年3月18日	409
CNH	534,375	USD	85,000	2015年3月18日	257
BRL	209,748	USD	77,000	2015年1月26日	73
CHF	65,050	USD	66,000	2015年3月18日	(45)
EUR	63,000	NOK	571,275	2015年3月18日	186
EUR	8,066	HUF	2,536,191	2015年3月18日	53
INR	5,424,275	USD	85,000	2015年1月15日	68
EUR	190,000	USD	230,839	2015年3月18日	651
CNH	875,048	USD	139,244	2015年3月18日	367
					(4,818,977)

注記2 - 先物契約

2014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>					
AUD	4	FUT AUST 10YR BOND 6%	2015年3月	417,812	2,619
CAD	10	FUT CAN BOND 10YR 6%	2015年3月	1,189,197	20,726
NZD	3	FUT NEW ZEALAND 3MO BILL	2015年12月	2,326,370	549
USD	15	FUT US LONG BD 20YR 6%	2015年3月	2,167,500	39,132
EUR	2	FUT 3MO EURO EURIBOR	2015年12月	608,385	213
JPY	4	FUT 3MO EUROYEN TFX	2015年3月	835,467	209
USD	6	FUT 90 DAY EURODOLLAR	2016年12月	1,471,950	300
USD	38	FUT 90 DAY EURODOLLAR	2015年6月	9,458,675	2,258
USD	19	FUT 90 DAY EURODOLLAR	2015年9月	4,718,888	2,100
JPY	4	FUT 3MO EUROYEN TFX	2015年6月	835,593	(42)
				24,029,837	68,064

売り持ちポジション

USD	(18)	FUT EURO FX CURRENCY	2015年3月	(2,740,950)	30,735
USD	(1)	FUT GBP CURRENCY	2015年3月	(97,256)	706
USD	(13)	FUT MXM CURRENCY	2015年3月	(439,400)	18,200
USD	(9)	FUT RAND CURRENCY	2015年3月	(383,850)	10,367
USD	(125)	FUT US NOTE 5YR 6%	2015年3月	(14,853,516)	6,305
EUR	(12)	FUT EUR OAT	2015年3月	(2,150,885)	(31,667)
EUR	(63)	FUT EURO BOBL 5YR 6%	2015年3月	(9,992,805)	(64,430)
EUR	(56)	FUT EURO BUND 10YR 6%	2015年3月	(10,627,220)	(177,134)
EUR	(6)	FUT EURO BUXL 30YR 4%	2015年3月	(1,132,129)	(50,843)
JPY	(2)	FUT JPN 10YR BD 6% (TSE)	2015年3月	(2,473,679)	(11,382)
GBP	(35)	FUT LONG GILT 10YR 4%	2015年3月	(6,478,267)	(140,926)
USD	(3)	FUT NEW ZEALAND DOLLAR	2015年3月	(233,730)	(3,225)
USD	(123)	FUT US NOTE 10YR 6%	2015年3月	(15,584,485)	(30,789)
USD	(5)	FUT US ULTRA BOND 30YR 6%	2015年3月	(825,938)	(23,786)
JPY	(46)	FUT 10YR MINI JGB	2015年3月	(5,687,538)	(25,458)
USD	(194)	FUT US 2YRNOTE 6%	2015年3月	(42,404,155)	73,769
				(116,105,803)	(419,558)

(351,494)

注記3 - 金利スワップ契約

2014年12月31日現在、ファンドは以下の未決済金利スワップ契約を有していた。

通貨	額面	銘柄名	満期日	経過利息 (米ドル)	未実現損益 (米ドル)
USD	1,355,000	Receive Fixed (4.5%) - Pay Floating (3M USD LIBOR)	2023年12月19日	0	102,503
USD	1,580,000	Receive Fixed (3.75%) - Pay Floating (3M USD LIBOR)	2034年12月18日	0	82,776
USD	1,310,000	Receive Fixed (3.5%) - Pay Floating (3M USD LIBOR)	2044年12月20日	0	37,250
USD	490,000	Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (1.5%)	2018年03月18日	0	(1,279)
USD	6,500,000	Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (2.25%)	2020年03月18日	0	(120,177)
USD	10,500,000	Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (2.5%)	2022年03月18日	0	(271,941)
USD	260,000	Receive Fixed (3%) - Pay Floating (3M USD LIBOR)	2025年03月18日	0	16,032
USD	3,900,000	Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (3.25%)	2030年03月18日	0	(352,767)
USD	110,000	Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (3.5%)	2045年03月18日	0	(18,538)
CAD	2,130,000	Receive Fixed (4%) - Pay Floating (3M CAD)	2023年12月19日	0	108,855
CAD	380,000	Receive Fixed (3.75%) - Pay Floating (3M CAD)	2034年12月18日	0	8,129
CAD	110,000	Receive Fixed (2.5%) - Pay Floating (3M CAD)	2025年03月18日	0	1,561
BRL	221,628	Receive Fixed (12.2625%) - Pay Floating (BRAZIL CETIP)	2021年01月04日	0	(894)
BRL	112,299	Receive Fixed (12.43%) - Pay Floating (BRAZIL CETIP)	2021年01月04日	0	(73)
BRL	72,775	Receive Fixed (12.59%) - Pay Floating (BRAZIL CETIP)	2021年01月04日	0	184
BRL	72,815	Receive Fixed (12.58%) - Pay Floating (BRAZIL CETIP)	2021年01月04日	0	169
BRL	77,585	Receive Fixed (12.6%) - Pay Floating (BRAZIL CETIP)	2021年01月04日	0	212
BRL	73,245	Receive Fixed (12.48%) - Pay Floating (BRAZIL CETIP)	2021年01月04日	0	19
BRL	354,685	Receive Fixed (12.04%) - Pay Floating (BRAZIL CETIP)	2021年01月04日	0	(3,091)
BRL	216,792	Receive Fixed (12.19%) - Pay Floating (BRAZIL CETIP)	2021年01月04日	0	(1,253)
BRL	262,395	Receive Fixed (12.216%) - Pay Floating (BRAZIL CETIP)	2021年01月04日	0	(1,384)
BRL	92,278	Receive Fixed (12.225%) - Pay Floating (BRAZIL CETIP)	2021年01月04日	0	(470)
BRL	152,483	Receive Fixed (12.5266%) - Pay Floating (BRAZIL CETIP)	2021年01月04日	0	129
BRL	265,000	Receive Fixed (12.57%) - Pay Floating (BRAZIL CETIP)	2021年01月04日	0	453
BRL	317,651	Receive Fixed (12.6483%) - Pay Floating (BRAZIL CETIP)	2021年01月04日	0	1,039
MXN	3,170,000	Receive Fixed (7.39%) - Pay Floating (28D MXN-TIE)	2024年12月03日	0	1,396
MXN	3,030,000	Receive Fixed (7.46%) - Pay Floating (28D MXN-TIE)	2024年12月04日	0	1,794
MXN	2,860,000	Receive Fixed (7.4%) - Pay Floating (28D MXN-TIE)	2024年12月04日	0	1,320
JPY	373,200,000	Receive Fixed (1.25%) - Pay Floating (JPY LIBOR 6M)	2023年12月19日	0	86,933
JPY	81,800,000	Receive Fixed (1.5%) - Pay Floating (JPY LIBOR 6M)	2045年03月21日	0	27,710
JPY	395,170,000	Receive Fixed (0.5%) - Pay Floating (JPY LIBOR 6M)	2025年03月18日	0	(15,682)
NZD	1,520,000	Receive Fixed (4.5%) - Pay Floating (3M BBR)	2019年12月17日	356	26,808
NZD	580,000	Receive Fixed (4.5%) - Pay Floating (3M BBR)	2025年03月18日	0	12,556
AUD	1,960,000	Receive Fixed (4.5%) - Pay Floating (6M BBR)	2024年09月17日	0	49,300
AUD	1,195,000	Receive Floating (6M BBR) - Pay Fixed (3.75%)	2019年12月17日	(341)	(45,604)
AUD	550,000	Receive Floating (6M BBR) - Pay Fixed (4.5%)	2024年12月18日	0	(12,886)
AUD	340,000	Receive Fixed (3.5%) - Pay Floating (6M BBR)	2025年03月18日	0	5,926
PLN	1,090,000	Receive Floating (6M WIBOR) - Pay Fixed (2.805%)	2024年11月07日	0	(3,751)
SEK	3,435,000	Receive Floating (3M SEK-STIBOR) - Pay Fixed (3.5%)	2023年12月19日	0	(37,485)
SEK	3,015,000	Receive Floating (3M SEK-STIBOR) - Pay Fixed (1.5%)	2025年03月18日	0	(7,167)
EUR	1,505,000	Receive Floating (6M EUR-EURIBOR) - Pay Fixed (3.25%)	2023年12月19日	0	(191,494)
EUR	110,000	Receive Floating (6M EUR-EURIBOR) - Pay Fixed (2.25%)	2034年12月18日	0	(4,054)
EUR	1,640,000	Receive Floating (6M EUR-EURIBOR) - Pay Fixed (2%)	2024年12月18日	0	(68,096)
EUR	60,000	Receive Floating (6M EUR-EURIBOR) - Pay Fixed (2.25%)	2045年03月18日	0	(14,091)
EUR	1,785,000	Receive Floating (6M EUR-EURIBOR) - Pay Fixed (1.5%)	2025年03月18日	0	(137,124)
EUR	210,000	Receive Floating (6M EUR-EURIBOR) - Pay Fixed (1.25%)	2022年03月18日	0	(12,064)
EUR	600,000	Receive Fixed (0.75%) - Pay Floating (6M EUR-EURIBOR)	2020年03月18日	0	13,014
CHF	920,000	Receive Floating (6M LIBOR) - Pay Fixed (1.5%)	2024年12月18日	0	(23,940)
MYR	100,000	Receive Fixed (4.85%) - Pay Floating (3M KLIBOR)	2024年12月12日	0	485
MYR	440,000	Receive Fixed (4.846%) - Pay Floating (3M KLIBOR)	2024年12月16日	0	2,109
MYR	170,000	Receive Fixed (4.83%) - Pay Floating (3M KLIBOR)	2024年12月16日	0	786
NOK	7,495,000	Receive Floating (6M NOK-NIBOR) - Pay Fixed (3.5%)	2024年12月18日	0	(45,043)
ZAR	3,220,000	Receive Fixed (8.7325%) - Pay Floating (3M JIBAR)	2024年12月10日	0	1,854
ZAR	4,060,000	Receive Fixed (8.732%) - Pay Floating (3M JIBAR)	2024年12月17日	0	2,285
GBP	2,555,000	Receive Floating (6M GBP-LIBOR) - Pay Fixed (3.75%)	2023年12月19日	0	(269,709)

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)
GBP	1,680,000	Receive Floating (6M GBP-LIBOR) - Pay Fixed (3.25%)	2034年12月18日	0	(113,405)
GBP	1,780,000	Receive Floating (6M GBP-LIBOR) - Pay Fixed (3%)	2044年12月20日	0	(90,620)
GBP	1,110,000	Receive Fixed (3.25%) - Pay Floating (6M GBP-LIBOR)	2024年12月18日	0	70,878
GBP	1,070,000	Receive Floating (6M GBP-LIBOR) - Pay Fixed (3.25%)	2024年09月17日	0	(70,180)
GBP	1,890,000	Receive Floating (6M GBP-LIBOR) - Pay Fixed (3%)	2025年03月18日	0	(293,956)
GBP	735,000	Receive Floating (6M GBP-LIBOR) - Pay Fixed (3.25%)	2045年03月20日	0	(245,940)
				15	(1,809,693)

注記4 - クレジット・デフォルト・スワップ契約

2014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	未実現益 (米ドル)
<i>プロテクション買いポジション</i>				
USD	5,175,000	CDX MARK NA HY 23 ICE 5 5%	2019年12月20日	323,720
USD	12,850,000	CDX NA IG 23 1 5Y 100BP 1%	2019年12月20日	207,891
				<u>531,611</u>
				531,611

野村マネー マザーファンド

第12期(2014年8月19日決算)
(計算期間：2013年8月20日～2014年8月19日)

《運用報告書》

受益者のみなさまへ

野村マネー マザーファンドの第12期の運用状況をご報告申し上げます。

●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

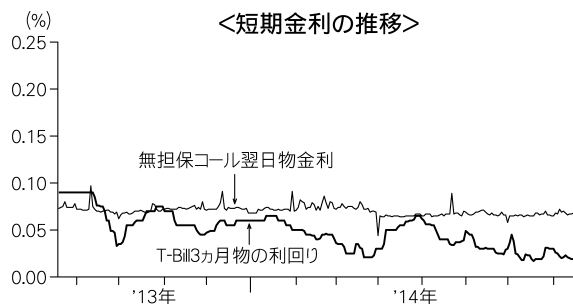
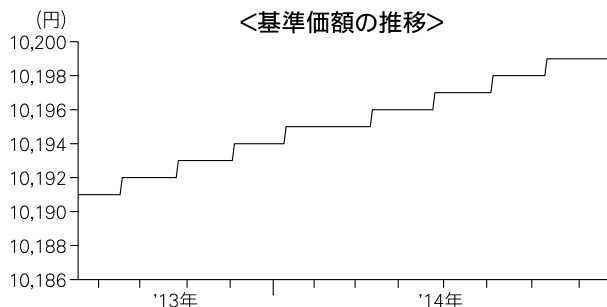
<http://www.nomura-am.co.jp/>

◎運用経過

1. 基準価額の推移

* 基準価額は0.08%の上昇

基準価額は、期初10,191円から期末は10,199円となりました。



○運用環境

国内経済は、2014年4月の消費税増税に伴う駆け込み需要の反動減の影響を受けつつも、期を通じて底堅く推移した個人消費や、企業収益の改善に伴い緩やかな増加がみられる設備投資などの内需が下支えとなる一方、輸出は弱めの動きとなりました。このような中、日本銀行は、前年比2%の物価上昇を目指す「量的・質的金融緩和」を継続しました。

●無担保コール翌日物金利の推移

概ね0.06%台～0.07%台で推移しました。

●T-Bill (国庫短期証券) 3ヵ月物の利回りの推移

- ・ 期初から2013年9月半ばまでは概ね0.09%台で推移しました。
- ・ 2013年9月末以降、需給の変化を受けて概ね0.02%台から0.07%台の範囲で推移し、期末には0.02%台となりました。

2. 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 (CP) 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、国債を中心に政府保証債や利付金融債、CP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・ローンなどにより運用してまいりました。

◎今後の運用方針

残存期間の短い公社債やCP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運用を行なう方針です。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

◎1万口当たりの費用の明細

項 目	当 期
(a) 保 管 費 用 等	0円
合 計	0

* (a) 保管費用等は、期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

* 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

◎期中の売買及び取引の状況 (自2013年8月20日 至2014年8月19日)

(1) 公社債

	買付額	売付額
国 内	千円	千円
国 債 証 券	84,793,709	58,094,433 (28,403,900)
特 殊 債 券	4,391,973	— (1,935,000)
社債券(投資法人債券を含む)	841,662	— (700,000)

* 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。

(2) その他有価証券

		買付額	売付額
国 内		千円	千円
コマーシャル・ペーパー		1,099,678	— (600,000)

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

*()内は償還等による増減分です。

◎組入資産の明細

(1) 国内(邦貨建)公社債

区 分	期 首					当 期 末								
	組入比率	うちBB格		残存期間別組入比率			額面金額	評価額	組入比率	うちBB格		残存期間別組入比率		
		以下組入比率	%	%	5年以上	2年以上				2年未満	以下組入比率	%	%	%
国 債 証 券	73.4 (60.2)	— (—)	— (—)	— (—)	73.4 (60.2)	2,179,350 (—)	2,179,848 (—)	25.2 (—)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	25.2 (—)	
特殊債券(除く金融債)	6.6 (6.6)	— (—)	— (—)	— (—)	6.6 (6.6)	2,290,000 (2,290,000)	2,301,511 (2,301,511)	26.6 (26.6)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	26.6 (26.6)	
金 融 債 券	0.9 (0.9)	— (—)	— (—)	— (—)	0.9 (0.9)	540,000 (540,000)	540,935 (540,935)	6.3 (6.3)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	6.3 (6.3)	
普通社債券(含む投資法人債券)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	140,000 (140,000)	140,014 (140,014)	1.6 (1.6)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	1.6 (1.6)	
合 計	80.9 (67.7)	— (—)	— (—)	— (—)	80.9 (67.7)	5,149,350 (2,970,000)	5,162,309 (2,982,460)	59.7 (34.5)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	59.7 (34.5)	

*()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。

*—印は組み入れなし。

*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。

国内(邦貨建)公社債銘柄別

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評価額	償還年月日
国 債 証 券	国庫債券 利付(2年)第320回	0.1	260,000	260,016	2014/9/15
	国庫債券 利付(2年)第321回	0.1	547,300	547,339	2014/10/15
	国庫債券 利付(2年)第322回	0.1	395,000	395,047	2014/11/15
	国庫債券 利付(2年)第323回	0.1	202,650	202,676	2014/12/15
	国庫債券 利付(2年)第324回	0.1	190,000	190,037	2015/1/15
	国庫債券 利付(2年)第325回	0.1	140,000	140,036	2015/2/15
	国庫債券 利付(2年)第327回	0.1	129,000	129,026	2015/4/15
	国庫債券 利付(5年)第85回	0.7	132,200	132,277	2014/9/20
	国庫債券 利付(5年)第86回	0.6	115,100	115,155	2014/9/20
	国庫債券 利付(10年)第263回	1.6	39,900	39,955	2014/9/20
	国庫債券 利付(10年)第264回	1.5	15,050	15,069	2014/9/20
	国庫債券 利付(20年)第27回	5.0	13,150	13,210	2014/9/22
小 計		—	—	2,179,848	—
特殊債券(除く金融債)	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第331回	1.8	63,000	63,029	2014/8/29
	道路債券 政府保証第334回	1.5	100,000	100,379	2014/11/28
	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第336回	1.4	170,000	170,984	2015/1/28

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第337回	1.3	千円 71,000	千円 71,447	2015/2/27
	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第338回	1.5	54,000	54,453	2015/3/27
	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第341回	1.3	100,000	100,927	2015/5/29
	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第343回	1.3	171,000	172,781	2015/6/30
	日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第345回	1.2	50,000	50,524	2015/7/29
	首都高速道路債券 政府保証第193回	1.5	100,000	100,139	2014/9/26
	首都高速道路債券 政府保証第195回	1.4	211,000	212,205	2015/1/26
	首都高速道路債券 政府保証第198回	1.3	10,000	10,103	2015/6/26
	阪神高速道路債券 政府保証第141回	1.5	53,000	53,202	2014/11/28
	阪神高速道路債券 政府保証第145回	1.4	10,000	10,087	2015/4/20
	阪神高速道路債券 政府保証第147回	1.2	50,000	50,526	2015/7/29
	公営企業債券 政府保証第842回	1.8	55,000	55,019	2014/8/26
	公営企業債券 政府保証第843回	1.5	30,000	30,048	2014/9/29
	公営企業債券 政府保証第844回	1.6	12,000	12,034	2014/10/28
	公営企業債券 政府保証第845回	1.5	60,000	60,228	2014/11/28
	公営企業債券 政府保証第847回	1.4	100,000	100,572	2015/1/27
	公営企業債券 政府保証第848回	1.3	105,000	105,654	2015/2/24
	中小企業債券 政府保証第182回	1.5	70,000	70,098	2014/9/24
	国民生活債券 政府保証第14回	1.5	375,000	375,359	2014/9/17
	都市再生債券 政府保証第22回	0.4	120,000	120,214	2015/3/10
関西国際空港債券 政府保証第47回	1.3	150,000	151,488	2015/6/17	
小 計		-	-	2,301,511	-
金 融 債 券	商工債券 利付第711回い号	1.0	100,000	100,022	2014/8/27
	商工債券 利付第718回い号	0.65	70,000	70,231	2015/3/27
	農林債券 利付第711回い号	1.05	70,000	70,016	2014/8/27
	農林債券 利付第719回い号	0.7	100,000	100,404	2015/4/27
	しんきん中金債券 利付第237回	1.0	50,000	50,011	2014/8/27
	しんきん中金債券 利付第242回	0.7	50,000	50,130	2015/1/27
小 計		-	-	540,935	-
普通社債券(含む投資法人債券)	東邦瓦斯 第35回社債間限定同順位特約付	0.3	140,000	140,014	2014/9/9
小 計		-	-	140,014	-
合 計		-	-	5,162,309	-

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(2) 国内その他有価証券

区 分	期 首		当 期 末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 -	% -	千円 499,839	% 5.8

*比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*一印は組み入れなし。

*金額の単位未満は切り捨て。

◎投資信託財産の構成 (2014年8月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	5,162,309	58.5
そ の 他 有 価 証 券	499,839	5.7
コール・ローン等、その他	3,165,958	35.8
投資信託財産総額	8,828,106	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

(2014年8月19日)現在

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	8,828,106,541
コール・ローン等	3,153,091,003
公社債(評価額)	5,162,309,235
その他有価証券	499,839,922
未 収 利 息	7,954,384
前 払 費 用	4,911,997
(B) 負 債	180,029,000
未 払 金	180,029,000
(C) 純資産総額(A-B)	8,648,077,541
元 本	8,478,942,189
次 期 繰 越 損 益 金	169,135,352
(D) 受 益 権 総 口 数	8,478,942,189口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,199円

◎損益の状況

(自2013年8月20日 至2014年8月19日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	24,840,577
受 取 利 息	23,802,394
そ の 他 収 益 金	1,038,183
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 19,039,618
売 買 益	69,649
売 買 損	△ 19,109,267
(C) 信 託 報 酬 等	△ 108,072
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	5,692,887
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	99,189,715
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	209,503,691
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 145,250,941
(H) 計 (D+E+F+G)	169,135,352
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	169,135,352

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

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

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

*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。

(注)期首元本額5,198百万円、期中追加設定元本額10,671百万円、期中一部解約元本額7,391百万円、計算口数当たり純資産額10,199円。

◎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 百万円
野村アフリカ株投資 マネーブル・ファンド	14
野村米国ハイ・イールド債券投資(マネーブルファンド)年2回決算型	86
野村新中国株投資 マネーブル・ファンド	34
野村日本ブランド株投資(マネーブルファンド)年2回決算型	557
野村新米国ハイ・イールド債券投資(マネーブルファンド)年2回決算型	13
野村ビクテ・ジェネリック&ゲノム マネーブル・ファンド	7
野村RCM・グリーン・テクノロジー マネーブル・ファンド	1
野村新興国消費関連株投資 マネーブル・ファンド	10
野村世界業種別投資シリーズ(マネーブル・ファンド)	34
ノムラ・アジア・シリーズ(マネーブル・ファンド)	304
野村新エマージング債券投資(マネーブルファンド)年2回決算型	6
野村クラウドコンピューティング&スマートグリッド関連株投資 マネーブルファンド	19
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(マネーブルファンド)年2回決算型	9
野村グローバルCB投資(マネーブルファンド)年2回決算型	4
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(マネーブルファンド)年2回決算型	65
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(マネーブルファンド)年2回決算型	1
野村日本スマートシティ株投資 マネーブルファンド	18
野村世界高金利通貨投資	151
野村新世界高金利通貨投資	0
コインの未来(毎月分配型)	3
コインの未来(年2回分配型)	0
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(欧州通貨コース)	0
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円コース)	0
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(豪ドルコース)	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(米ドルコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(ユーロコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(南アフリカランドコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース)毎月分配型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(円コース)年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(米ドルコース)年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(ユーロコース)年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	0
野村米国ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース)年2回決算型	0
野村日本ブランド株投資(円コース)毎月分配型	0
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)毎月分配型	0
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	0
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	0
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)毎月分配型	0
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)年2回決算型	0
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	0
野村日本ブランド株投資(ユーロコース)年2回決算型	0
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)年2回決算型	0
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	0
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	0
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	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(南アフリカランドコース)毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース)毎月分配型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(円コース)年2回決算型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース)年2回決算型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	0
野村新米国ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース)年2回決算型	0

ファンド名	当期末
	元本額 百万円
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投資 Aコース	0
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投資 Bコース	0
野村新エマージング債券投資(円コース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(米ドルコース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(豪ドルコース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(南アフリカランドコース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(中国元コース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(インドネシアルピアコース)毎月分配型	0
野村新エマージング債券投資(円コース)年2回決算型	0
野村新エマージング債券投資(米ドルコース)年2回決算型	0
野村新エマージング債券投資(豪ドルコース)年2回決算型	0
野村新エマージング債券投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	0
野村新エマージング債券投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	0
野村新エマージング債券投資(中国元コース)年2回決算型	0
野村新エマージング債券投資(インドネシアルピアコース)年2回決算型	0
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型	0
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(資源国通貨コース)毎月分配型	0
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(アジア通貨コース)毎月分配型	0
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(円コース)年2回決算型	0
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(資源国通貨コース)年2回決算型	0
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(アジア通貨コース)年2回決算型	0
野村高金利国際機関債投資(毎月分配型)	49
野村アジアCB投資(毎月分配型)	0
野村グローバルCB投資(円コース)毎月分配型	0
野村グローバルCB投資(資源国通貨コース)毎月分配型	0
野村グローバルCB投資(アジア通貨コース)毎月分配型	0
野村グローバルCB投資(円コース)年2回決算型	0
野村グローバルCB投資(資源国通貨コース)年2回決算型	0
野村グローバルCB投資(アジア通貨コース)年2回決算型	0
ノムラ新興国債券ファンド(野村SMA向け)	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(円コース)毎月分配型	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(米ドルコース)毎月分配型	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(豪ドルコース)毎月分配型	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(円コース)年2回決算型	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(米ドルコース)年2回決算型	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(豪ドルコース)年2回決算型	0
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	0
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	0
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	0
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	0
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	0
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(円コース)毎月分配型	0
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(資源国通貨コース)毎月分配型	0
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(アジア通貨コース)毎月分配型	0
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(円コース)年2回決算型	0
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(資源国通貨コース)年2回決算型	0
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(アジア通貨コース)年2回決算型	0
野村米国ブランド株投資(円コース)毎月分配型	0
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	0
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	0
野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型	0
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	0
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	0
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型	0
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	0
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	0

ファンド名	当期末
	元本額
	百万円
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型	0
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	0
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	0
野村テンプルトン・トータル・リターン Aコース	0
野村テンプルトン・トータル・リターン Bコース	0
野村テンプルトン・トータル・リターン Cコース	0
野村テンプルトン・トータル・リターン Dコース	0
野村高金利国際機関債投信(年2回決算型)	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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 Aコース)	0
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)	0
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	0
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	0
野村グローバルREITプレミアム(円コース)毎月分配型	0
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	0
野村グローバルREITプレミアム(円コース)年2回決算型	0
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	0
野村日本高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	0
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	0
野村日本高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
野村カルミニャック・ファンド Aコース	0
野村カルミニャック・ファンド Bコース	0
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)毎月分配型	0
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	0
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)毎月分配型	0
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	0
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	0
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	0
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	0
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	0
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型	0
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	0

ファンド名	当期末
	元本額
	百万円
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)年2回決算型	0
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	0
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	0
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	0
ノムラ THE USA Aコース	0
ノムラ THE USA Bコース	0
ノムラ THE EUROPE Aコース	0
ノムラ THE EUROPE Bコース	0
米国変動好金利ファンド Aコース	8
米国変動好金利ファンド Bコース	0
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	0
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	0
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	0
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	0
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	0
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	0
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	0
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	0
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	0
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	0
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	0
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	0
野村グローバルボンド投信 Aコース	0
野村グローバルボンド投信 Bコース	0
野村グローバルボンド投信 Cコース	0
野村グローバルボンド投信 Dコース	0
野村グローバルボンド投信 Eコース	0
野村グローバルボンド投信 Fコース	0
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	0
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	0
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	0
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	0
第1回 野村短期公社債ファンド	0
第2回 野村短期公社債ファンド	0
第3回 野村短期公社債ファンド	0
第4回 野村短期公社債ファンド	0
第5回 野村短期公社債ファンド	0
第6回 野村短期公社債ファンド	0
第7回 野村短期公社債ファンド	0
第8回 野村短期公社債ファンド	0
第9回 野村短期公社債ファンド	0
第10回 野村短期公社債ファンド	0
第11回 野村短期公社債ファンド	0
第12回 野村短期公社債ファンド	0
野村グローバル債券為替ファンド(適格機関投資家転売制限付)	110
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(非課税適格機関投資家専用)	3,806
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家転売制限付)	3,030
グローバル・マルチテーマ・ファンドP ハイブリッド型(適格機関投資家専用)	0
野村DCテンプルトン・トータル・リターン Aコース	0
野村DCテンプルトン・トータル・リターン Bコース	0

*単位未満は切り捨て。

< 「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。

(2015年8月6日現在)

年 月	日
2015年8月	31
9月	7
10月	—
11月	11、26
12月	24、25、28

※2015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。