

野村グローバルボンド投信 Fコース

運用報告書(全体版)

第18期(決算日2016年3月7日) 第19期(決算日2016年4月6日) 第20期(決算日2016年5月6日)
第21期(決算日2016年6月6日) 第22期(決算日2016年7月6日) 第23期(決算日2016年8月8日)

作成対象期間(2016年2月9日～2016年8月8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CRSクラス受益証券および円建ての国内籍の投資信託である野村マネー マザーファンド受益証券への投資を通じて、高利回り事業債(ハイ・イールド債)を含む世界の債券および米ドル建ての企業向け貸付債権(バンクローン)を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。 各受益証券への投資比率は、通常の状態においては、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ボンドーCRS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 F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CRS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、コマースナル・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CRS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 F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 | | | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 投 資 信 託 組 入 比 率 | 純 資 産 額 |
|-----------------|-------------|--------|--------|----------------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------------------|------------------|
| | | 税 分 | 込 配 | み 金 騰 落 中 率 | | | | |
| (設定日) | 円 | 円 | % | % | % | % | 百万円 | |
| 2014年8月11日 | 10,000 | — | — | — | — | — | 3,771 | |
| 1期(2014年10月6日) | 10,041 | 70 | 1.1 | 0.0 | — | 98.8 | 11,497 | |
| 2期(2014年11月6日) | 10,578 | 70 | 6.0 | 0.0 | — | 98.9 | 14,788 | |
| 3期(2014年12月8日) | 10,822 | 70 | 3.0 | 0.0 | — | 99.0 | 18,263 | |
| 4期(2015年1月6日) | 10,388 | 70 | △3.4 | 0.0 | — | 98.8 | 19,546 | |
| 5期(2015年2月6日) | 10,135 | 70 | △1.8 | 0.0 | — | 99.0 | 20,298 | |
| 6期(2015年3月6日) | 10,096 | 70 | 0.3 | 0.0 | — | 99.3 | 20,482 | |
| 7期(2015年4月6日) | 9,886 | 70 | △1.4 | 0.0 | — | 99.0 | 20,282 | |
| 8期(2015年5月7日) | 9,845 | 70 | 0.3 | 0.0 | — | 98.8 | 20,475 | |
| 9期(2015年6月8日) | 10,049 | 70 | 2.8 | 0.0 | — | 99.0 | 21,194 | |
| 10期(2015年7月6日) | 9,868 | 70 | △1.1 | 0.0 | — | 98.9 | 20,937 | |
| 11期(2015年8月6日) | 9,574 | 70 | △2.3 | 0.0 | — | 99.2 | 20,093 | |
| 12期(2015年9月7日) | 8,580 | 70 | △9.7 | 0.0 | — | 99.0 | 17,839 | |
| 13期(2015年10月6日) | 8,430 | 70 | △0.9 | 0.0 | — | 99.1 | 17,159 | |
| 14期(2015年11月6日) | 8,769 | 70 | 4.9 | 0.0 | — | 98.7 | 17,208 | |
| 15期(2015年12月7日) | 8,611 | 70 | △1.0 | 0.0 | — | 99.0 | 15,962 | |
| 16期(2016年1月6日) | 7,895 | 70 | △7.5 | 0.0 | — | 98.9 | 13,666 | |
| 17期(2016年2月8日) | 7,496 | 70 | △4.2 | 0.0 | — | 98.7 | 12,698 | |
| 18期(2016年3月7日) | 7,460 | 70 | 0.5 | 0.0 | — | 99.1 | 12,451 | |
| 19期(2016年4月6日) | 7,533 | 70 | 1.9 | 0.0 | — | 98.9 | 12,401 | |
| 20期(2016年5月6日) | 7,573 | 70 | 1.5 | 0.0 | — | 98.9 | 12,279 | |
| 21期(2016年6月6日) | 7,310 | 70 | △2.5 | 0.0 | — | 99.1 | 11,667 | |
| 22期(2016年7月6日) | 7,046 | 70 | △2.7 | 0.0 | — | 98.7 | 11,146 | |
| 23期(2016年8月8日) | 7,197 | 70 | 3.1 | 0.0 | — | 98.5 | 11,172 | |

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

| 決算期 | 年 月 日 | 基準 | 価 額 | | 債 組 入 比 | 券 率 | 債 先 物 比 | 券 率 | 投 資 信 託 | 組 入 比 | 率 |
|------|-----------|-------|-------|------|---------|-----|---------|-----|---------|-------|---|
| | | | 騰 落 率 | 率 | | | | | | | |
| 第18期 | (期 首) | 円 | | % | | % | | | | | % |
| | 2016年2月8日 | 7,496 | | — | 0.0 | | — | | | 98.7 | |
| | 2月末 | 7,231 | | △3.5 | 0.0 | | — | | | 97.9 | |
| 第19期 | (期 末) | | | | | | | | | | |
| | 2016年3月7日 | 7,530 | | 0.5 | 0.0 | | — | | | 99.1 | |
| | (期 首) | | | | | | | | | | |
| 第19期 | 2016年3月7日 | 7,460 | | — | 0.0 | | — | | | 99.1 | |
| | 3月末 | 7,723 | | 3.5 | 0.0 | | — | | | 98.0 | |
| | (期 末) | | | | | | | | | | |
| 第20期 | 2016年4月6日 | 7,603 | | 1.9 | 0.0 | | — | | | 98.9 | |
| | (期 首) | | | | | | | | | | |
| | 2016年4月6日 | 7,533 | | — | 0.0 | | — | | | 98.9 | |
| 第21期 | 4月末 | 7,825 | | 3.9 | 0.0 | | — | | | 97.9 | |
| | (期 末) | | | | | | | | | | |
| | 2016年5月6日 | 7,643 | | 1.5 | 0.0 | | — | | | 98.9 | |
| 第21期 | (期 首) | | | | | | | | | | |
| | 2016年5月6日 | 7,573 | | — | 0.0 | | — | | | 98.9 | |
| | 5月末 | 7,465 | | △1.4 | 0.0 | | — | | | 98.2 | |
| 第22期 | (期 末) | | | | | | | | | | |
| | 2016年6月6日 | 7,380 | | △2.5 | 0.0 | | — | | | 99.1 | |
| | (期 首) | | | | | | | | | | |
| 第22期 | 2016年6月6日 | 7,310 | | — | 0.0 | | — | | | 99.1 | |
| | 6月末 | 7,085 | | △3.1 | 0.0 | | — | | | 97.6 | |
| | (期 末) | | | | | | | | | | |
| 第23期 | 2016年7月6日 | 7,116 | | △2.7 | 0.0 | | — | | | 98.7 | |
| | (期 首) | | | | | | | | | | |
| | 2016年7月6日 | 7,046 | | — | 0.0 | | — | | | 98.7 | |
| 第23期 | 7月末 | 7,405 | | 5.1 | 0.0 | | — | | | 98.0 | |
| | (期 末) | | | | | | | | | | |
| | 2016年8月8日 | 7,267 | | 3.1 | 0.0 | | — | | | 98.5 | |

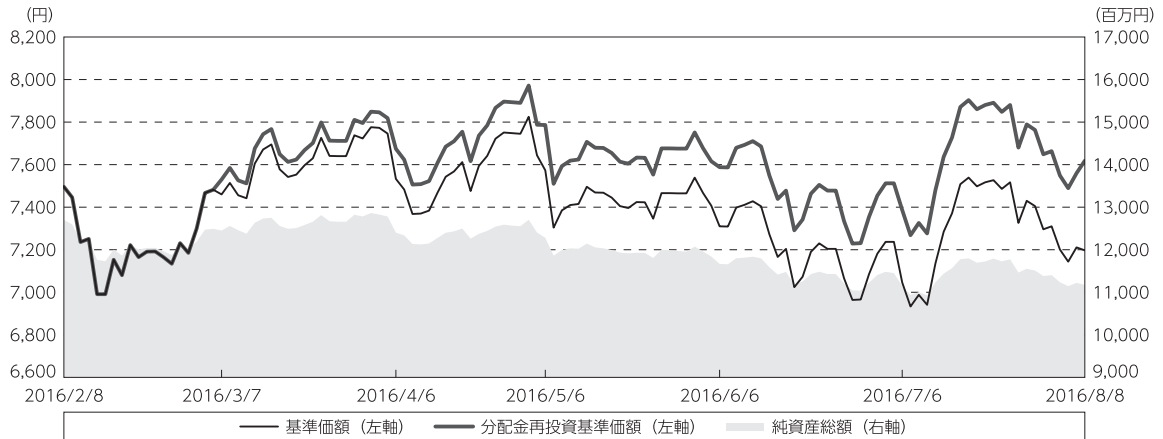
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



- (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(2016年2月8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7,496円から当作成期末には7,197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※¹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/選定通貨※²の為替変動

※¹ 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。

※² 選定通貨は、投資対象とする外国投資信託の投資顧問会社が選定した通貨を指します。

○投資環境

<ハイ・イールド債券市場>

世界経済の先行きに対する懸念の高まりや原油価格の下落などから、投資家のリスク回避姿勢が強まった局面で下落する場面がありました。良好な米経済指標が発表されたことなどを背景に、米国の経済成長に対する楽観的な見方が広がったこと、FOMC（米連邦公開市場委員会）において、年内の利上げが緩やかなペースになるとの観測が市場で強まったこと、原油価格が上昇したことなどから、当作成期間では値上がりとなりました。

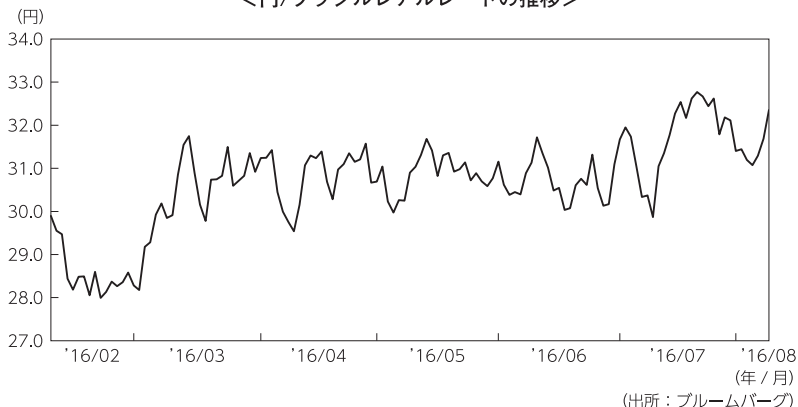
<バンクローン市場>

米国経済の先行きに対して楽観的な見方が広がったことや、原油価格が上昇したことなどを背景に、投資家心理が改善したことから、当作成期間では値上がりとなりました。

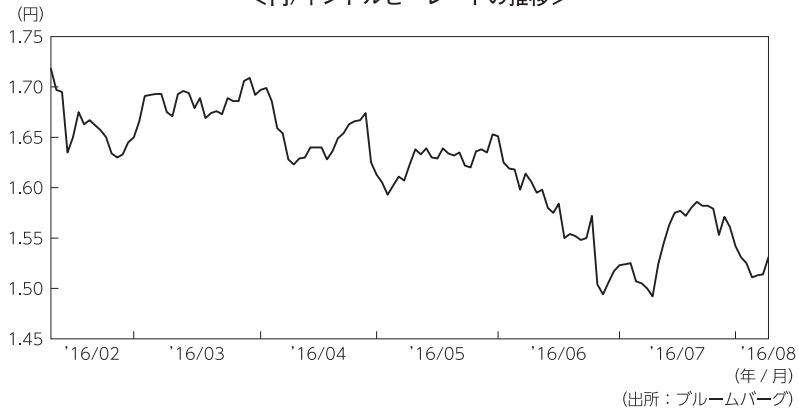
<為替レート>

足元では、英国で行われた国民投票において、EU（欧州連合）からの離脱に対する支持が過半数を超える結果となったことなどから世界的な成長鈍化が意識され、米利上げ期待が後退しました。また、資源価格が上昇基調で推移する中で、南アフリカランドなどの新興国通貨が堅調に推移しました。ブラジルでは、ルセフ大統領の弾劾プロセスが進展する中で、テメル大統領代行率いる新たな政権が構造改革や財政緊縮への取り組みを進めており、政策遂行に対する期待が高まりました。貿易黒字が定着し、経常赤字が減少傾向であるなど、一部の経済指標が改善を示しつつある点や他通貨に比べ相対的に高い金利水準であることなども、通貨を下支えました。一方で、トルコでは、大統領権限の強化を目指すエルドアン大統領と対立していたダウトオール首相が首相職及び与党公正発展党（AKP）の党首職を辞任する意向を表明しました。また、軍の一部によるクーデター未遂事件が発生し、多数の死者を出しました。非常事態宣言が発動され、事件が観光収入の減少や資本流出につながる可能性や、エルドアン大統領による粛清が拡大していることなどが嫌気されました。

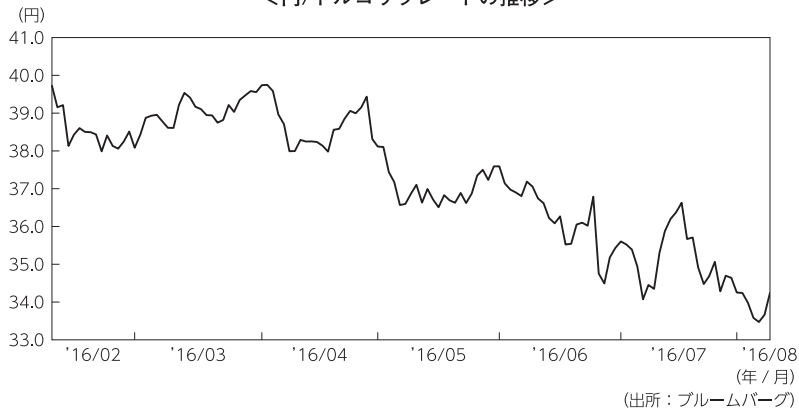
<円/ブラジルリアルレートの推移>



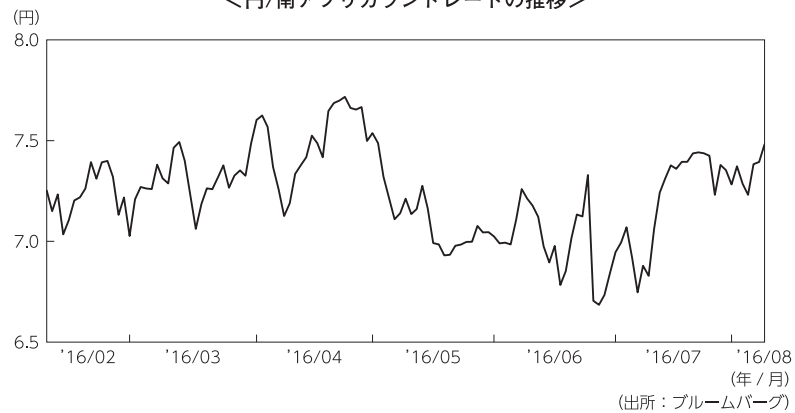
<円/インドルピーレートの推移>



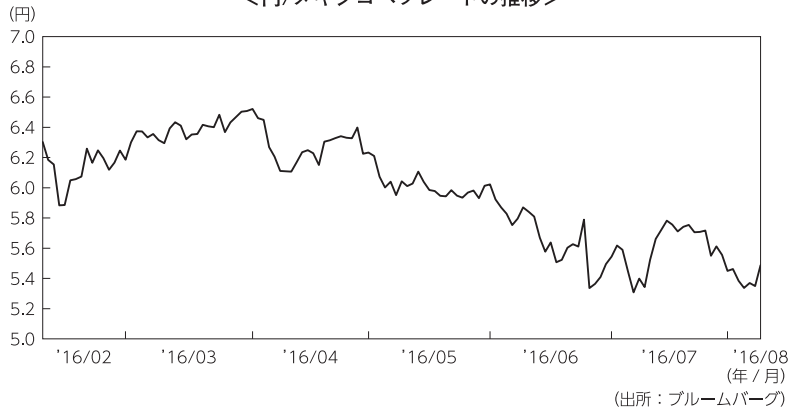
<円/トルコリラレートの推移>



<円/南アフリカランドレートの推移>



<円/メキシコペソレートの推移>



○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 Fコース (米ドル売り選定通貨買い 毎月分配型)]

[ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ボンドーCRS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CRS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CRS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2.9%、AA格8.7%、A格9.1%、BBB格6.6%、BB格19.1%、B格33.4%、CCC格以下および無格付13.4%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。

なお、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（基礎的諸条件）、流動性等を考慮し、相対的に金利が高い5つの通貨を選定し、外国為替予約取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引等を活用し、原則として実質的に米ドルを売り各選定通貨を買う為替取引を行いました。選定通貨は定期的に見直しを行いました。当作成期末時点ではブラジルレアル、トルコリラ、南アフリカランド、インドルピー、メキシコペソを選定しています。

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・ブロードは、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、現地通貨建ての世界主要国の債券、現地通貨建ての新興国の債券をそれぞれ対象としたインデックスであり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。

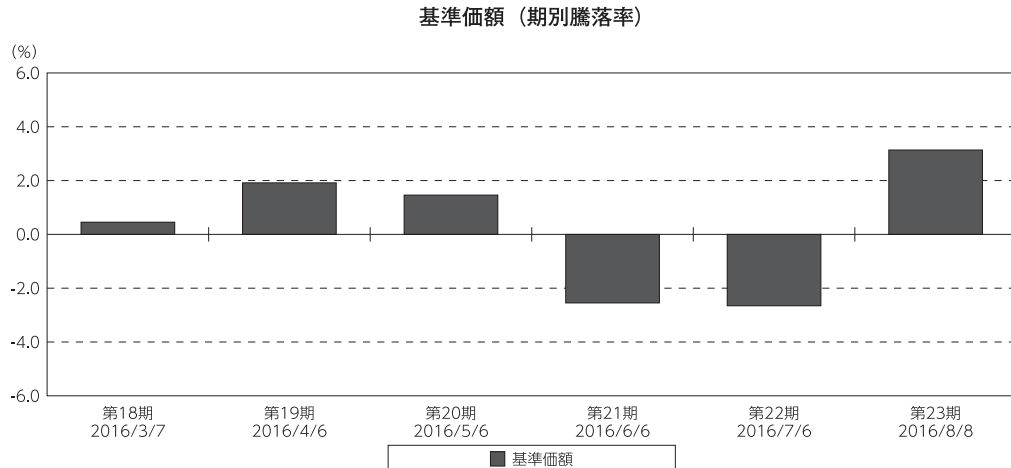
[野村マネー マザーファンド]

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。



(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18期 | 第19期 | 第20期 | 第21期 | 第22期 | 第23期 |
|-----------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| | 2016年2月9日～ 2016年3月7日 | 2016年3月8日～ 2016年4月6日 | 2016年4月7日～ 2016年5月6日 | 2016年5月7日～ 2016年6月6日 | 2016年6月7日～ 2016年7月6日 | 2016年7月7日～ 2016年8月8日 |
| 当期分配金 | 70 | 70 | 70 | 70 | 70 | 70 |
| (対基準価額比率) | 0.930% | 0.921% | 0.916% | 0.949% | 0.984% | 0.963% |
| 当期の収益 | 70 | 70 | 70 | 70 | 70 | 70 |
| 当期の収益以外 | — | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,526 | 2,674 | 2,827 | 2,984 | 3,147 | 3,315 |

(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 Fコース(米ドル売り選定通貨買い 毎月分配型)]

[ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ボンドーCRS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CRS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CRS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。

通貨の選択にあたっては、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。

[野村マネー マザーファンド]

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

(2016年2月9日～2016年8月8日)

| 項 目 | 第18期～第23期 | | 項 目 の 概 要 |
|------------------------|-----------|------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 40 | % 0.537 | (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) | (7) | (0.091) | ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等 |
| (販 売 会 社) | (32) | (0.430) | 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) | (1) | (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 | 40 | 0.538 | |
| 作成期間の平均基準価額は、7,455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

(2016年2月9日～2016年8月8日)

投資信託証券

| 銘 柄 | | 第18期～第23期 | | | |
|-----|---------------------------------------|-----------|-----------|---------|---------|
| | | 買 付 | | 売 付 | |
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 国 内 | 口 | 千円 | 口 | 千円 | |
| | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド-グローバル・ボンド-CISクラス | 263,978 | 1,457,896 | 174,804 | 987,641 |

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2016年2月9日～2016年8月8日)

利害関係人との取引状況

<野村グローバルボンド投信 Fコース>

| 区 分 | 第18期～第23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 | $\frac{D}{C}$ |
| 預金 | 百万円 4,941 | 百万円 4,941 | % 100.0 | 百万円 4,941 | 百万円 4,941 | % 100.0 |

<野村マネー マザーファンド>

| 区 分 | 第18期～第23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 19,166 | 百万円 1,977 | % 10.3 | 百万円 - | 百万円 - | % - |
| 預金 | 231,734 | 231,734 | 100.0 | 231,734 | 231,734 | 100.0 |

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、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年8月8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17期末 | 第23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-CRSクラス | 2,063,610 | 2,152,784 | 11,007,184 | 98.5 |
| 合 計 | 2,063,610 | 2,152,784 | 11,007,184 | 98.5 |

*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託残高

| 銘 柄 | 第17期末 | 第23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 | 1,001 |

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年8月8日現在)

| 項 目 | 第23期末 | |
|---------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託受益証券 | 11,007,184 | 97.0 |
| 野村マネー マザーファンド | 1,001 | 0.0 |
| コール・ローン等、その他 | 339,104 | 3.0 |
| 投資信託財産総額 | 11,347,289 | 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18期末 | 第19期末 | 第20期末 | 第21期末 | 第22期末 | 第23期末 |
|--------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 2016年3月7日現在 | 2016年4月6日現在 | 2016年5月6日現在 | 2016年6月6日現在 | 2016年7月6日現在 | 2016年8月8日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 12,599,703,344 | 12,596,585,008 | 12,834,920,801 | 11,830,273,188 | 11,319,384,660 | 11,347,289,330 |
| コール・ローン等 | 254,663,179 | 264,266,932 | 691,459,037 | 219,734,132 | 316,490,691 | 247,482,305 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 12,344,038,986 | 12,269,105,440 | 12,142,460,587 | 11,562,227,651 | 11,001,892,792 | 11,007,184,592 |
| 野村マネー マザーファンド(評価額) | 1,001,177 | 1,001,177 | 1,001,177 | 1,001,177 | 1,001,177 | 1,001,177 |
| 未収入金 | — | 62,211,458 | — | 47,310,228 | — | 91,621,256 |
| 未収利息 | 2 | 1 | — | — | — | — |
| (B) 負債 | 148,044,060 | 195,003,430 | 555,137,766 | 162,937,710 | 172,597,914 | 174,388,449 |
| 未払金 | — | — | 366,262,810 | — | — | — |
| 未払収益分配金 | 116,842,104 | 115,247,193 | 113,508,437 | 111,730,538 | 110,736,569 | 108,666,616 |
| 未払解約金 | 21,151,860 | 68,535,875 | 64,345,053 | 40,206,716 | 51,695,669 | 54,550,373 |
| 未払信託報酬 | 10,030,045 | 11,197,976 | 10,998,275 | 10,978,195 | 10,144,917 | 11,148,847 |
| 未払利息 | — | — | 1,205 | 315 | 481 | 329 |
| その他未払費用 | 20,051 | 22,386 | 21,986 | 21,946 | 20,278 | 22,284 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 12,451,659,284 | 12,401,581,578 | 12,279,783,035 | 11,667,335,478 | 11,146,786,746 | 11,172,900,881 |
| 元本 | 16,691,729,148 | 16,463,884,750 | 16,215,491,051 | 15,961,505,570 | 15,819,509,946 | 15,523,802,307 |
| 次期繰越損益金 | △ 4,240,069,864 | △ 4,062,303,172 | △ 3,935,708,016 | △ 4,294,170,092 | △ 4,672,723,200 | △ 4,350,901,426 |
| (D) 受益権総口数 | 16,691,729,148口 | 16,463,884,750口 | 16,215,491,051口 | 15,961,505,570口 | 15,819,509,946口 | 15,523,802,307口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 7,460円 | 7,533円 | 7,573円 | 7,310円 | 7,046円 | 7,197円 |

(注) 第18期首元本額は16,939,682,077円、第18～23期中追加設定元本額は608,760,940円、第18～23期中一部解約元本額は2,024,640,710円、1口当たり純資産額は、第18期0.7460円、第19期0.7533円、第20期0.7573円、第21期0.7310円、第22期0.7046円、第23期0.7197円です。

○損益の状況

| 項 目 | 第18期 | 第19期 | 第20期 | 第21期 | 第22期 | 第23期 |
|------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| | 2016年2月9日～ 2016年3月7日 | 2016年3月8日～ 2016年4月6日 | 2016年4月7日～ 2016年5月6日 | 2016年5月7日～ 2016年6月6日 | 2016年6月7日～ 2016年7月6日 | 2016年7月7日～ 2016年8月8日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | 366,281,963 | 369,355,797 | 369,434,574 | 372,323,085 | 376,943,929 | 378,595,546 |
| 受取配当金 | 366,279,550 | 369,355,772 | 369,448,685 | 372,335,939 | 376,952,849 | 378,605,518 |
| 受取利息 | 2,413 | 25 | 5 | — | — | — |
| 支払利息 | — | — | △ 14,116 | △ 12,854 | △ 8,920 | △ 9,972 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 297,693,968 | △ 124,141,111 | △ 182,146,203 | △ 669,865,058 | △ 672,049,747 | △ 32,260,811 |
| 売買益 | 11,582,676 | 1,564,674 | 3,347,669 | 7,054,690 | 4,655,036 | 5,523,440 |
| 売買損 | △ 309,276,644 | △ 125,705,785 | △ 185,493,872 | △ 676,919,748 | △ 676,704,783 | △ 37,784,251 |
| (C) 信託報酬等 | △ 10,050,096 | △ 11,220,362 | △ 11,020,261 | △ 11,900,141 | △ 10,165,195 | △ 11,171,131 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 58,537,899 | 233,994,324 | 176,268,110 | △ 308,542,114 | △ 305,271,013 | 335,163,604 |
| (E) 前期繰越損益金 | △4,449,970,711 | △4,430,691,065 | △4,217,716,962 | △4,073,751,532 | △4,430,726,823 | △4,697,837,005 |
| (F) 追加信託差損益金 | 268,205,052 | 249,640,762 | 219,249,273 | 199,854,092 | 174,011,205 | 120,438,591 |
| (配当等相当額) | (695,524,838) | (698,139,682) | (713,842,785) | (717,885,896) | (733,238,738) | (771,204,725) |
| (売買損益相当額) | (△ 427,319,786) | (△ 448,498,920) | (△ 494,593,512) | (△ 518,031,804) | (△ 559,227,533) | (△ 650,766,134) |
| (G) 計(D+E+F) | △4,123,227,760 | △3,947,055,979 | △3,822,199,579 | △4,182,439,554 | △4,561,986,631 | △4,242,234,810 |
| (H) 収益分配金 | △ 116,842,104 | △ 115,247,193 | △ 113,508,437 | △ 111,730,538 | △ 110,736,569 | △ 108,666,616 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △4,240,069,864 | △4,062,303,172 | △3,935,708,016 | △4,294,170,092 | △4,672,723,200 | △4,350,901,426 |
| 追加信託差損益金 | 268,205,052 | 249,640,762 | 219,249,273 | 199,854,092 | 174,011,205 | 120,438,591 |
| (配当等相当額) | (695,524,840) | (698,139,683) | (713,842,786) | (717,885,897) | (733,238,738) | (771,204,729) |
| (売買損益相当額) | (△ 427,319,788) | (△ 448,498,921) | (△ 494,593,513) | (△ 518,031,805) | (△ 559,227,533) | (△ 650,766,138) |
| 分配準備積立金 | 3,522,194,031 | 3,705,525,380 | 3,870,866,425 | 4,046,079,555 | 4,245,987,063 | 4,376,046,934 |
| 繰越損益金 | △8,030,468,947 | △8,017,469,314 | △8,025,823,714 | △8,540,103,739 | △9,092,721,468 | △8,847,386,951 |

* 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(2016年2月9日～2016年8月8日)は以下の通りです。

| 項 目 | 第18期 | 第19期 | 第20期 | 第21期 | 第22期 | 第23期 |
|------------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| | 2016年2月9日～ 2016年3月7日 | 2016年3月8日～ 2016年4月6日 | 2016年4月7日～ 2016年5月6日 | 2016年5月7日～ 2016年6月6日 | 2016年6月7日～ 2016年7月6日 | 2016年7月7日～ 2016年8月8日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 356,232,256円 | 358,135,748円 | 358,414,534円 | 361,323,240円 | 366,779,137円 | 367,424,755円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金繰戻後) | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 695,524,840円 | 698,139,683円 | 713,842,786円 | 717,885,897円 | 733,238,738円 | 771,204,729円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 3,282,803,879円 | 3,462,636,825円 | 3,625,960,328円 | 3,796,486,853円 | 3,989,944,495円 | 4,117,288,795円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 4,334,560,975円 | 4,518,912,256円 | 4,698,217,648円 | 4,875,695,990円 | 5,089,962,370円 | 5,255,918,279円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 2,596円 | 2,744円 | 2,897円 | 3,054円 | 3,217円 | 3,385円 |
| g. 分配金 | 116,842,104円 | 115,247,193円 | 113,508,437円 | 111,730,538円 | 110,736,569円 | 108,666,616円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 70円 | 70円 | 70円 | 70円 | 70円 | 70円 |

○分配金のお知らせ

| | 第18期 | 第19期 | 第20期 | 第21期 | 第22期 | 第23期 |
|----------------|------|------|------|------|------|------|
| 1万口当たり分配金(税込み) | 70円 | 70円 | 70円 | 70円 | 70円 | 70円 |

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

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

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

○お知らせ

該当事項はございません。

○(参考情報)親投資信託の組入資産の明細

(2016年8月8日現在)

<野村マネー マザーファンド>

下記は、野村マネー マザーファンド全体(19,316,932千口)の内容です。

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 第23期末 | | | | | | |
|---------------------|--------------|--------------|---------|--------------------|-----------|------|--------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うちBB格以下 組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 地方債証券 | 2,598,010 | 2,604,964 | 13.2 | — | — | — | 13.2 |
| | (2,598,010) | (2,604,964) | (13.2) | (—) | (—) | (—) | (13.2) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 3,725,000 | 3,730,530 | 18.9 | — | — | — | 18.9 |
| | (3,725,000) | (3,730,530) | (18.9) | (—) | (—) | (—) | (18.9) |
| 金融債券 | 3,780,000 | 3,783,959 | 19.2 | — | — | — | 19.2 |
| | (3,780,000) | (3,783,959) | (19.2) | (—) | (—) | (—) | (19.2) |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 1,500,000 | 1,501,963 | 7.6 | — | — | — | 7.6 |
| | (1,500,000) | (1,501,963) | (7.6) | (—) | (—) | (—) | (7.6) |
| 合 計 | 11,603,010 | 11,621,418 | 58.9 | — | — | — | 58.9 |
| | (11,603,010) | (11,621,418) | (58.9) | (—) | (—) | (—) | (58.9) |

* ()内は非上場債で内書きです。

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

*金額の単位未満は切り捨て。

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

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 柄 | 第23期末 | | | |
|--------------------|-----------------------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 東京都 | 公募第638回 | 1.9 | 300,000 | 300,657 | 2016/9/20 |
| 北海道 | 公募平成18年度第7回 | 2.0 | 1,500 | 1,506 | 2016/10/31 |
| 北海道 | 公募平成18年度第10回 | 1.9 | 200,000 | 201,489 | 2016/12/28 |
| 北海道 | 公募(5年)平成23年度第12回 | 0.38 | 5,000 | 5,008 | 2017/1/31 |
| 北海道 | 公募(5年)平成23年度第14回 | 0.35 | 200,000 | 200,501 | 2017/3/23 |
| 神奈川県 | 公募第143回 | 1.77 | 100,000 | 100,649 | 2016/12/20 |
| 神奈川県 | 公募(5年)第49回 | 0.37 | 101,700 | 101,738 | 2016/9/20 |
| 大阪府 | 公募第294回 | 2.0 | 12,000 | 12,031 | 2016/9/28 |
| 大阪府 | 公募第295回 | 1.9 | 1,000 | 1,004 | 2016/10/28 |
| 大阪府 | 公募(5年)第77回 | 0.42 | 100,000 | 100,081 | 2016/10/28 |
| 兵庫県 | 公募平成18年度第8回 | 2.1 | 200,000 | 200,179 | 2016/8/24 |
| 埼玉県 | 公募(5年)平成23年度第5回 | 0.41 | 200,000 | 200,121 | 2016/9/29 |
| 福岡県 | 公募平成18年度第3回 | 1.9 | 1,000 | 1,004 | 2016/10/31 |
| 千葉県 | 公募平成18年度第4回 | 1.8 | 8,600 | 8,631 | 2016/10/25 |
| 群馬県 | 公募第3回 | 1.9 | 9,000 | 9,047 | 2016/11/25 |
| 大分県 | 公募平成18年度第1回 | 1.8 | 198,000 | 198,813 | 2016/10/31 |
| 共同発行市場地方債 | 公募第41回 | 2.0 | 6,000 | 6,005 | 2016/8/25 |
| 共同発行市場地方債 | 公募第43回 | 1.8 | 4,000 | 4,014 | 2016/10/25 |
| 共同発行市場地方債 | 公募第44回 | 1.8 | 100,000 | 100,529 | 2016/11/25 |
| 島根県 | 公募平成23年度第1回 | 0.38 | 2,500 | 2,502 | 2016/11/25 |
| 熊本県 | 公募平成18年度第2回 | 1.8 | 7,500 | 7,528 | 2016/10/27 |
| 名古屋市 | 公募第456回 | 1.82 | 16,000 | 16,032 | 2016/9/20 |
| 京都市 | 公募平成23年度第3回 | 0.364 | 4,000 | 4,001 | 2016/9/29 |
| 神戸市 | 公募平成23年度第3回 | 0.375 | 200,000 | 200,019 | 2016/8/16 |
| 横浜市 | 公募平成18年度第3回 | 1.87 | 200,000 | 201,371 | 2016/12/20 |
| 札幌市 | 公募(5年)平成23年度第5回 | 0.4 | 12,900 | 12,904 | 2016/9/20 |
| 川崎市 | 公募(5年)第29回 | 0.36 | 12,200 | 12,204 | 2016/9/20 |
| 川崎市 | 公募(5年)第31回 | 0.27 | 2,000 | 2,003 | 2017/3/17 |
| 北九州市 | 公募(5年)平成23年度第1回 | 0.36 | 7,000 | 7,002 | 2016/9/28 |
| 福岡市 | 公募平成23年度第3回 | 0.39 | 300,000 | 300,077 | 2016/8/26 |
| 広島市 | 公募平成18年度第1回 | 1.82 | 6,000 | 6,040 | 2016/12/26 |
| 仙台市 | 公募平成23年度第1回 | 0.36 | 59,410 | 59,489 | 2017/1/27 |
| さいたま市 | 公募第4回 | 1.8 | 5,000 | 5,033 | 2016/12/26 |
| 鹿児島県 | 公募平成18年度第1回 | 1.9 | 7,200 | 7,230 | 2016/10/31 |
| 鹿児島県 | 公募(5年)平成23年度第1回 | 0.37 | 8,500 | 8,506 | 2016/10/31 |
| 小 | 計 | | 2,598,010 | 2,604,964 | |
| 特殊債券(除く金融債) | | | | | |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券(4年)第2回 | 0.13 | 200,000 | 200,023 | 2016/8/30 |
| | 日本政策投資銀行債券 政府保証第13回 | 2.0 | 290,000 | 290,235 | 2016/8/25 |
| | 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第17回 | 2.0 | 100,000 | 100,124 | 2016/8/31 |
| | 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第19回 | 1.8 | 700,000 | 701,680 | 2016/9/29 |
| | 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第21回 | 1.8 | 125,000 | 125,712 | 2016/11/30 |
| | 日本政策投資銀行債券 財投機関債第27回 | 1.98 | 100,000 | 100,229 | 2016/9/20 |
| | 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第15回 | 2.05 | 100,000 | 100,235 | 2016/9/20 |
| | 地方公共団体金融機構債券(5年)第9回 | 0.34 | 100,000 | 100,262 | 2017/4/28 |
| | 地方公共団体金融機構債券(2年)第2回 | 0.1 | 200,000 | 200,188 | 2017/3/28 |

| 銘 | 柄 | 第23期末 | | | |
|------------------------|--------------------|-------|------------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| 公営企業債券 | 第24回財投機関債 | 1.94 | 100,000 | 100,707 | 2016/12/20 |
| 首都高速道路 | 第8回 | 0.439 | 140,000 | 140,062 | 2016/9/20 |
| 日本政策金融公庫社債 | 第20回財投機関債 | 0.471 | 900,000 | 900,490 | 2016/9/20 |
| 日本政策金融公庫社債 | 第43回財投機関債 | 0.101 | 200,000 | 200,084 | 2016/11/18 |
| 関西国際空港社債 | 財投機関債第31回 | 0.504 | 70,000 | 70,038 | 2016/9/20 |
| 日本学生支援債券 | 財投機関債第38回 | 0.1 | 300,000 | 300,217 | 2017/2/20 |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 財投機関債第10回 | 1.99 | 100,000 | 100,236 | 2016/9/20 |
| 小 | 計 | | 3,725,000 | 3,730,530 | |
| 金融債券 | | | | | |
| 商工債券 | 利付第736回い号 | 0.45 | 300,000 | 300,166 | 2016/9/27 |
| 商工債券 | 利付第737回い号 | 0.45 | 200,000 | 200,180 | 2016/10/27 |
| 商工債券 | 利付第738回い号 | 0.45 | 200,000 | 200,265 | 2016/11/25 |
| 農林債券 | 利付第735回い号 | 0.45 | 150,000 | 150,029 | 2016/8/26 |
| 農林債券 | 利付第736回い号 | 0.5 | 750,000 | 750,506 | 2016/9/27 |
| 農林債券 | 利付第737回い号 | 0.5 | 80,000 | 80,073 | 2016/10/27 |
| 農林債券 | 利付第739回い号 | 0.5 | 500,000 | 500,958 | 2016/12/27 |
| 農林債券 | 利付第742回い号 | 0.45 | 200,000 | 200,566 | 2017/3/27 |
| しんきん中金債券 | 利付第261回 | 0.45 | 500,000 | 500,136 | 2016/8/26 |
| しんきん中金債券 | 利付第262回 | 0.45 | 100,000 | 100,058 | 2016/9/27 |
| しんきん中金債券 | 利付第263回 | 0.5 | 100,000 | 100,107 | 2016/10/27 |
| しんきん中金債券 | 利付第266回 | 0.45 | 300,000 | 300,659 | 2017/1/27 |
| 商工債券 | 利付(3年)第164回 | 0.2 | 200,000 | 200,042 | 2016/9/27 |
| 商工債券 | 利付(3年)第166回 | 0.2 | 100,000 | 100,058 | 2016/11/25 |
| 商工債券 | 利付(3年)第171回 | 0.2 | 100,000 | 100,148 | 2017/4/27 |
| 小 | 計 | | 3,780,000 | 3,783,959 | |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | | | | |
| アサヒグループホールディングス | 第1回特定社債間限定同順位特約付 | 0.52 | 200,000 | 200,212 | 2016/10/21 |
| みずほコーポレート銀行 | 第27回特定社債間限定同順位特約付 | 0.515 | 500,000 | 500,504 | 2016/10/20 |
| 三菱東京UFJ銀行 | 第129回特定社債間限定同順位特約付 | 0.465 | 100,000 | 100,091 | 2016/10/20 |
| 三菱東京UFJ銀行 | 第148回特定社債間限定同順位特約付 | 0.195 | 100,000 | 100,047 | 2016/10/31 |
| 三井住友銀行 | 第55回社債間限定同順位特約付 | 0.47 | 100,000 | 100,097 | 2016/10/20 |
| トヨタファイナンス | 第23回社債間限定同等特約付 | 1.97 | 100,000 | 100,223 | 2016/9/20 |
| 三菱UFJリース | 第15回社債間限定同順位特約付 | 0.66 | 400,000 | 400,787 | 2016/12/14 |
| 小 | 計 | | 1,500,000 | 1,501,963 | |
| 合 | 計 | | 11,603,010 | 11,621,418 | |

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

国内その他有価証券

| 区 分 | 第23期末 | |
|-------------|-----------------|----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| コマーシャル・ペーパー | 千円 1,199,980 | % 6.1 |

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

* 金額の単位未満は切り捨て。

Nomura Multi Managers Fund – Global Bond

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ボンド

2015年12月31日決算

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

| 形 態 | ケイマン諸島籍円建て外国投資信託 | | | | | | | | |
|--------------------------|---|--------|--------|------------|--|----------|---|--------------------------|---|
| 主要投資対象 | ◆高利回り事業債(ハイ・イールド債)を含む世界の債券および米ドル建ての企業向け貸付債権(バンクローン) | | | | | | | | |
| 投資方針 | <p>●ハイ・イールド債^{※1}を含む世界の債券および米ドル建てのバンクローン^{※2}を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。</p> <p>※1 ハイ・イールド債とは、スタンダード・アンド・プアーズ社による格付がBB+以下、あるいはムーディーズ・インベスターズ社による格付がBa1以下の債券(格付のない場合は同等の信用度を有すると判断されるものを含みます。)をいいます。</p> <p>※2 バンクローンとは、事業会社等が事業の拡大等に必要資金を調達するために、銀行等の金融機関等から借入れるローンをいいます。</p> <p>●投資にあたっては、3つの投資戦略(「ハイ・イールド債戦略」、「バンクローン戦略」、「ストラテジック・インカム/トータル・リターン戦略」)に配分します。なお、1投資戦略あたりの配分比率は、原則として、純資産総額の25%以上50%以内に維持することを基本とします。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>投資戦略</th> <th>主な投資方針</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>ハイ・イールド債戦略</td> <td>世界のハイ・イールド債を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。</td> </tr> <tr> <td>バンクローン戦略</td> <td>米ドル建てのバンクローンを主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。</td> </tr> <tr> <td>ストラテジック・インカム/トータル・リターン戦略</td> <td>ハイ・イールド債を含む世界の債券を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインとキャピタルゲインの獲得によるトータル・リターンの追求を目指します。</td> </tr> </tbody> </table> <p>●バンクローンへの投資にあたっては、主として、変動金利型で、債券等に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。</p> <p>●JPYクラスについては、実質的な通貨配分にかかわらず、原則として純資産総額を米ドル換算した額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行います。</p> <p>●USDクラスについては、対円で為替ヘッジを行いません。</p> <p>●CRSクラスについては、実質的な通貨配分にかかわらず、原則として純資産総額を米ドル換算した額とほぼ同額程度の米ドルを売り、米ドル以外の選定通貨を買う為替取引を行います。</p> <p>●投資顧問会社が、世界の債券および米ドル建てのバンクローンの運用を行う副投資顧問会社の選定と、各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率を決定します。</p> <p>●副投資顧問会社の選定にあたっては、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、各投資戦略の運用において優れていると判断した運用会社を選定します。</p> <p>●投資顧問会社は選定した副投資顧問会社およびファンド全体のリスク特性の状況を絶えずモニターし、必要に応じて各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率の変更や副投資顧問会社の人替を適宜行います。</p> <p><CRSクラスにおける通貨運用方針></p> <p>●原則として、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ブロードおよびJP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・ブロード構成国の通貨の中から、金利水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、相対的に金利が高い5つの通貨を選定することを基本とします。選定通貨は定期的(原則、毎月)見直すこととします。</p> <p>●1通貨当りのエクスポージャーについては、原則として、純資産総額の10%~30%程度の範囲内に維持することを基本とします。</p> <p>●ファンダメンタルズおよび流動性を考慮して、選択される通貨が4以下または6以上となる場合があります。この場合、1通貨当りのエクスポージャーは上記の範囲を超える場合があります。</p> | 投資戦略 | 主な投資方針 | ハイ・イールド債戦略 | 世界のハイ・イールド債を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。 | バンクローン戦略 | 米ドル建てのバンクローンを主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。 | ストラテジック・インカム/トータル・リターン戦略 | ハイ・イールド債を含む世界の債券を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインとキャピタルゲインの獲得によるトータル・リターンの追求を目指します。 |
| | 投資戦略 | 主な投資方針 | | | | | | | |
| ハイ・イールド債戦略 | 世界のハイ・イールド債を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。 | | | | | | | | |
| バンクローン戦略 | 米ドル建てのバンクローンを主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。 | | | | | | | | |
| ストラテジック・インカム/トータル・リターン戦略 | ハイ・イールド債を含む世界の債券を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインとキャピタルゲインの獲得によるトータル・リターンの追求を目指します。 | | | | | | | | |
| 受託会社 | グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー | | | | | | | | |
| 投資顧問会社 | 野村アセットマネジメント株式会社 | | | | | | | | |
| 管理事務代行会社 保管銀行 | ノムラ・バンク(ルクセンブルグ)エス・エー | | | | | | | | |

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

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

「投資顧問会社は、米国1940年投資顧問法規則第206条(4)項2号(「カストディールール」)に基づき、保管銀行から受益者または受益者のために投資顧問会社が任命した「独立した代理人」に対し、米国法で定められている四半期口座明細書およびその他の必要な通知を送付させることが求められています。投資顧問会社はArthur F. Bell, Jr. & Associates, L.L.C.(「アーサー・ベル社」)を、「独立した代理人」に任命しました。投資家が同意する場合または独立の第三者が投資家にとって最善の利益になると判断する場合を除き、アーサー・ベル社の「独立した代理人」としての地位は失われず、また、報酬を含めアーサー・ベル社に不利益な契約変更は行われません。」

純資産計算書
2015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 | | 325,823,082 |
| (取得原価: 352,690,789米ドル) | | |
| 現金預金等 | | 22,454,779 |
| 金利スワップ契約に係る評価差益 | | 37,167 |
| 先物契約に係る評価差益 | | 465,211 |
| デリバティブ取引に係る委託証拠金 | | 1,846,532 |
| 受益証券発行未収金 | | 180,437 |
| ブローカーからの受取金 | | 6,874,843 |
| 未収収益 | | 3,927,659 |
| 現金および現金等価物に係る利息 | | 74 |
| 設立費用 | | 21,300 |
| | | <hr/> |
| 資産合計 | | 361,631,084 |
| | | <hr/> |
| 負債 | | |
| 銀行借越金 | | 249,477 |
| 外国為替先渡し契約に係る評価差損 | | 3,160,945 |
| クレジット・デフォルト・スワップ契約に係る評価差損 | | 112,490 |
| 金利スワップ契約に係る未払利息 | | 329 |
| 受益証券買戻支払金 | | 645,843 |
| ブローカーへの未払金 | | 16,249,987 |
| 未払費用 | | 932,923 |
| | | <hr/> |
| 負債合計 | | 21,351,994 |
| | | <hr/> |
| 純資産総額 | | 340,279,090 |
| | | <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) | 8,715 | 148,525 | 1,294,344,326 |
| 通貨セレクトクラス(円) | 6,689 | 2,388,696 | 15,977,090,312 |
| 米ドルクラス(円) | 10,484 | 2,261,640 | 23,711,779,645 |

運用計算書

2015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 | 5,054 |
| 債券利息 | 20,187,381 |
| 金利スワップ契約に係る受取利息 | 5,501 |
| 受取配当金等 | 648,006 |
| 収益合計 | 20,845,942 |
| 費用 | |
| 投資顧問および共同投資顧問報酬 | 3,442,064 |
| 事務管理代行報酬 | 434,635 |
| 保管費用 | 130,778 |
| 源泉徴収税 | 1,974 |
| 金利スワップ契約に係る支払利息 | 6,889 |
| 当座借越利息 | 230 |
| 取引銀行報酬 | 180,599 |
| 銀行手数料 | 350,820 |
| 受託報酬 | 86,999 |
| 法務報酬 | 2,869 |
| 立替費用 | 33,315 |
| 専門家報酬 | 74,617 |
| 設立費用償却 | 14,200 |
| 雑費用 | 3,468 |
| 費用合計 | 4,763,457 |
| 純投資損益 | 16,082,485 |
| 投資有価証券売買に係る損益 | (6,899,476) |
| 先物契約に係る損益 | (349,906) |
| 外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益 | (22,974,020) |
| 金利スワップ契約に係る損益 | (1,958,346) |
| クレジット・デフォルト・スワップ契約に係る損益 | 533,134 |
| 当期実現純損益 | (31,648,614) |
| 投資有価証券評価損益の増減 | (21,484,816) |
| 先物契約に係る評価損益の増減 | 816,705 |
| 金利スワップ契約に係る評価損益の増減 | 1,846,860 |
| 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 | (644,101) |
| 外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減 | 1,658,032 |
| 当期評価差損益 | (17,807,320) |
| 運用の結果による純資産の増減額 | (33,373,449) |

純資産変動計算書
2015年12月31日に終了する計測期間
(金額は米ドル表示)

| | |
|-----------------|--------------|
| 期首純資産総額 | 423,023,063 |
| 純投資損益 | 16,082,485 |
| 当期実現純損益 | (31,648,614) |
| 当期評価差損益 | (17,807,320) |
| 運用の結果による純資産の増減額 | (33,373,449) |
| 受益証券の発行手取金 | 109,138,074 |
| 受益証券の買戻支払金 | (96,355,070) |
| | 12,783,004 |
| 受益者への支払分配金 | (62,153,528) |
| 期末純資産総額 | 340,279,090 |

発行済受益証券数の変動表
2015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 | 145,280 |
| 発行受益証券数 | 74,738 |
| 買戻受益証券数 | (71,493) |
| 期末現在発行済受益証券数 | 148,525 |
| 通貨セレクトクラス | |
| 期首受益証券数 | 2,160,384 |
| 発行受益証券数 | 774,597 |
| 買戻受益証券数 | (546,285) |
| 期末現在発行済受益証券数 | 2,388,696 |
| 米ドルクラス | |
| 期首受益証券数 | 2,420,356 |
| 発行受益証券数 | 465,782 |
| 買戻受益証券数 | (624,498) |
| 期末現在発行済受益証券数 | 2,261,640 |

統計情報
2015年12月31日現在
(未監査)

| | 2015 | 2014 |
|--------------|----------------|----------------|
| 期末純資産総額(米ドル) | 340,279,090 | 423,023,063 |
| 日本円クラス(円) | | |
| 期末純資産総額 | 1,294,344,326 | 1,408,343,284 |
| 期末1口当たり純資産価格 | 8,715 | 9,694 |
| 通貨セレクトクラス(円) | | |
| 期末純資産総額 | 15,977,090,312 | 21,608,194,312 |
| 期末1口当たり純資産価格 | 6,689 | 10,002 |
| 米ドルクラス(円) | | |
| 期末純資産総額 | 23,711,779,645 | 27,530,491,534 |
| 期末1口当たり純資産価格 | 10,484 | 11,375 |

組入資産明細
2015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 | 707,519 | 0.21 |
| USD | 650,000 | ANZ FRN 08/08/22 EMTN | 670,962 | 655,580 | 0.19 |
| | | | 1,392,979 | 1,363,099 | 0.40 |
| 国債 | | | | | |
| AUD | 3,850,000 | AUSTRALIAN GVT 1.75% 21/11/20 146 | 2,665,109 | 2,747,729 | 0.80 |
| | | | 2,665,109 | 2,747,729 | 0.80 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 72,000 | FMG RES AUG 06 9.75% 01/03/22 144A | 68,133 | 65,880 | 0.02 |
| USD | 25,000 | FMG RES AUG 06 8.25% 01/11/19 144A | 20,375 | 19,844 | 0.01 |
| | | | 88,508 | 85,724 | 0.03 |
| | | 合計: オーストラリア | 4,146,596 | 4,196,552 | 1.23 |
| ベルギー | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| EUR | 1,305,000 | BELGIUM KINGDOM 2.6% 22/06/24 72 | 1,862,486 | 1,644,568 | 0.48 |
| | | | 1,862,486 | 1,644,568 | 0.48 |
| | | 合計: ベルギー | 1,862,486 | 1,644,568 | 0.48 |
| 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 | 514,675 | 0.16 |
| USD | 211,000 | NCL CORP 4.625% 15/11/20 144A | 211,060 | 208,363 | 0.06 |
| USD | 200,000 | DIGICEL LTD 6.75% 01/03/23 144A | 200,000 | 167,000 | 0.05 |
| USD | 200,000 | DIGICEL LTD 8.25% 30/09/20 144A | 201,500 | 164,000 | 0.05 |
| USD | 200,000 | DIGICEL GP LTD 7.125% 01/04/22 144A | 200,250 | 151,000 | 0.04 |
| USD | 172,000 | VIKING CRUISES LTD 6.25% 15/5/25 14 | 172,000 | 141,040 | 0.04 |
| USD | 75,000 | NCL CORP 5.25% 15/11/19 144A | 75,000 | 76,500 | 0.02 |
| USD | 83,000 | WEATHERFORD BERMUDA 6.75% 15/09/40 | 61,628 | 58,100 | 0.02 |
| | | | 1,632,063 | 1,480,678 | 0.44 |
| | | 合計: バミューダ諸島 | 1,632,063 | 1,480,678 | 0.44 |
| 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 | 663,801 | 0.19 |
| USD | 483,000 | STUDIO CITY FIN 8.5% 01/12/20 144A | 533,111 | 467,303 | 0.14 |
| | | | 1,195,711 | 1,131,104 | 0.33 |
| | | 合計: 英領ヴァージン諸島 | 1,195,711 | 1,131,104 | 0.33 |
| カナダ | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 280,000 | TRANSCANADA TRUST FRN 20/05/75 | 280,000 | 256,200 | 0.08 |
| | | | 280,000 | 256,200 | 0.08 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 562,000 | VP11 ESCROW CORP 7.5% 15/07/21 144A | 613,666 | 563,404 | 0.16 |

| 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 | 483,000 | BOMBARDIER INC 6% 15/10/22 144A | 495,980 | 338,583 | 0.09 |
| USD | 325,000 | BKW 6% 01/04/22 144A | 325,187 | 336,375 | 0.09 |
| USD | 321,000 | VRX ESCROW 5.875% 15/05/23 144A | 314,882 | 289,571 | 0.08 |
| USD | 310,000 | BROOKFIELD RESID 6.375% 15/5/25 144 | 310,035 | 288,300 | 0.07 |
| USD | 220,000 | CONCORDIA HLTH COR 7% 15/04/23 144A | 202,188 | 190,300 | 0.05 |
| USD | 194,000 | NORBORD INC 6.25% 15/04/23 144A | 195,335 | 190,120 | 0.06 |
| USD | 170,000 | NOVELIS INC 8.75% 15/12/20 | 180,838 | 155,550 | 0.05 |
| USD | 225,000 | MEG ENERGY CORP 6.375% 30/1/23 144A | 197,656 | 154,125 | 0.05 |
| USD | 150,000 | VRX ESCROW 6.125% 15/4/25 144A | 135,636 | 135,000 | 0.04 |
| USD | 125,000 | VPII ESCROW CORP 6.75% 15/8/18 144a | 132,188 | 124,375 | 0.04 |
| USD | 172,000 | BOMBARDIER INC 7.5% 15/03/25 144A | 167,200 | 120,400 | 0.04 |
| USD | 85,000 | AIR CANADA 6.75% 01/10/19 144A | 90,056 | 88,241 | 0.03 |
| USD | 300,000 | ULTRA PETROLEUM 5.75% 15/12/18 144A | 303,000 | 72,000 | 0.02 |
| USD | 75,000 | CASCADES INC 5.75% 15/07/23 144A | 75,000 | 72,000 | 0.02 |
| USD | 161,000 | TECH RESOURCES LTD 6.25% 15/07/41 | 102,059 | 70,035 | 0.02 |
| USD | 75,000 | MEG ENERGY CORP 7% 31/03/24 144A | 70,098 | 53,250 | 0.02 |
| USD | 50,000 | AIR CANADA 8.75% 01/04/20 144A | 55,313 | 53,250 | 0.02 |
| USD | 50,000 | MPL 2 ACQUISITION 9.875% 15/8/18 14 | 52,625 | 52,000 | 0.02 |
| USD | 50,000 | KISSNER MILLING CO 7.25% 01/06/19 1 | 51,750 | 47,375 | 0.01 |
| USD | 50,000 | SEVEN GENERATION 6.75% 01/05/23 144 | 45,250 | 42,000 | 0.01 |
| USD | 58,000 | TECK RESOURCES LTD 3.75% 01/02/23 | 46,183 | 25,520 | 0.01 |
| USD | 89,000 | ULTRA PETROLEUM 6.125% 1/10/24 144A | 74,163 | 20,248 | 0.01 |
| USD | 47,000 | TECK RESOURCES LTD 6% 15/08/40 | 29,669 | 19,740 | 0.01 |
| USD | 200,000 | SANJEL CORP 7.5% 19/06/19 | 153,000 | 18,000 | 0.01 |
| USD | 25,000 | THOMPSON CREEK MET 7.375% 01/06/18 | 25,094 | 4,750 | 0.00 |
| | | | 4,444,051 | 3,524,512 | 1.03 |
| | | 合計: カナダ | 4,724,051 | 3,780,712 | 1.11 |
| | | ケイマン諸島 | | | |
| 資産担保証券 | | | | | |
| USD | 750,000 | WESTW 07-2A A1 CLO FRN 25/4/22 | 350,321 | 350,780 | 0.11 |
| USD | 800,000 | BABSN 07-1A A1 CLO FRN 18/01/21 | 316,703 | 317,371 | 0.09 |
| USD | 500,000 | STNY 07-1A A1 CLO FRN 18/04/22 | 285,919 | 285,441 | 0.08 |
| USD | 400,000 | STRN 07-1A A1 CLO FRN 13/05/22 | 141,454 | 141,976 | 0.04 |
| USD | 350,000 | ABERD 08-1A A CLO FRN 01/11/18 | 133,504 | 133,431 | 0.04 |
| | | | 1,227,901 | 1,228,999 | 0.36 |
| ステップアップ/ダウン債 | | | | | |
| USD | 450,000 | TRANSOCEAN INC STUP 6.375% 15/12/21 | 387,367 | 290,812 | 0.08 |
| USD | 25,000 | TRANSOCEAN INC STUP 5.05% 15/12/16 | 25,313 | 24,423 | 0.01 |
| | | | 412,680 | 315,235 | 0.09 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 650,000 | MIZUHO FIN GP CAY 4.2% 18/7/22 REGS | 680,983 | 662,510 | 0.20 |
| USD | 503,000 | SEAGATE HDD CAY 4.75% 01/06/23 | 478,875 | 439,269 | 0.13 |
| USD | 400,000 | UPCB FINANCE IV 5.375% 15/1/25 144A | 390,500 | 377,000 | 0.11 |
| USD | 200,000 | NEXTEER AUTO 5.875% 15/11/21 144A | 200,000 | 204,000 | 0.06 |
| USD | 200,000 | ALIBABA GP HDGS 2.5% 28/11/19 | 199,236 | 195,446 | 0.06 |
| USD | 200,000 | WYNN MACAU 5.25% 15/10/21 144A | 193,500 | 176,000 | 0.05 |
| | | | 2,143,094 | 2,054,225 | 0.61 |
| | | 合計: ケイマン諸島 | 3,783,675 | 3,598,459 | 1.06 |
| | | 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 | 194,828 | 0.06 |
| | | | 207,180 | 194,828 | 0.06 |
| | | 合計: コスタリカ | 207,180 | 194,828 | 0.06 |

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|----------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| クロアチア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| EUR | 150,000 | REP OF CROATIA 3.875% 30/05/22 | 169,027 | 164,274 | 0.05 |
| | | | 169,027 | 164,274 | 0.05 |
| | | 合計: クロアチア | 169,027 | 164,274 | 0.05 |
| ドミニカ共和国 | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 110,000 | DOMINICAN REP 6.85% 27/01/45 REGS | 114,345 | 104,315 | 0.03 |
| USD | 100,000 | DOMINICAN REP 7.45% 30/04/44 144A | 111,440 | 100,750 | 0.03 |
| | | | 225,785 | 205,065 | 0.06 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 100,000 | DOMINICAN REP 5.875% 18/04/24 REGS | 103,100 | 99,500 | 0.03 |
| | | | 103,100 | 99,500 | 0.03 |
| | | 合計: ドミニカ共和国 | 328,885 | 304,565 | 0.09 |
| フランス | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 500,000 | ENGIE SA FRN 10/07/49 | 705,552 | 576,997 | 0.18 |
| EUR | 400,000 | TOTAL SA 2.625% 29/12/49 emtn | 463,190 | 385,529 | 0.11 |
| EUR | 200,000 | SCOR SE FRN 08/06/46 | 210,164 | 212,154 | 0.06 |
| USD | 200,000 | EDF FRN 29/12/49 144A | 210,000 | 190,000 | 0.06 |
| GBP | 100,000 | CREDIT AGRICOLE SA FRN 29/06/49 | 165,037 | 150,456 | 0.04 |
| | | | 1,753,943 | 1,515,136 | 0.45 |
| 国債 | | | | | |
| EUR | 2,200,000 | FRANCE OAT 1.75% 25/11/24 | 2,795,536 | 2,600,384 | 0.76 |
| | | | 2,795,536 | 2,600,384 | 0.76 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 500,000 | EDF 6.95% 26/01/39 | 671,499 | 616,576 | 0.18 |
| USD | 600,000 | BNP PARIBAS 4.25% 15/10/24 | 601,250 | 593,039 | 0.17 |
| USD | 600,000 | NUMERICABLE GRP 6% 15/05/22 144A | 591,938 | 572,532 | 0.17 |
| EUR | 400,000 | BANQUE FED CRED 2.625% 18/03/24 EMT | 553,530 | 476,808 | 0.14 |
| EUR | 400,000 | BPCE 2.125% 17/03/21 EMTN | 537,143 | 462,599 | 0.14 |
| USD | 400,000 | NUMERICABLE GRP 4.875% 15/05/19 144 | 403,000 | 396,000 | 0.12 |
| EUR | 300,000 | BNP PARIBAS 2.375% 20/05/24 EMTN | 406,397 | 350,225 | 0.10 |
| | | | 3,764,757 | 3,467,779 | 1.02 |
| | | 合計: フランス | 8,314,236 | 7,583,299 | 2.23 |
| ドイツ | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| EUR | 700,000 | ALLIANZ SE FRN 29/09/49 | 879,224 | 744,115 | 0.21 |
| USD | 200,000 | DEUTSCHE BANK FRN 29/12/49 | 200,130 | 194,918 | 0.06 |
| | | | 1,079,354 | 939,033 | 0.27 |
| 国債 | | | | | |
| EUR | 425,000 | BUNDES DEUTSCH 3.25% 04/07/42 | 658,163 | 652,620 | 0.20 |
| EUR | 35,000 | BUNDESREP DEUTSCHLAND 2.5% 15/8/46 | 51,322 | 47,769 | 0.01 |
| | | | 709,485 | 700,389 | 0.21 |

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 600,000 | UNITYMEDIA KABEL 6.125% 15/01/25 14 | 601,250 | 592,890 | 0.17 |
| USD | 350,000 | UNITYMEDIA KABEL 5% 15/01/25 144A | 350,000 | 334,250 | 0.10 |
| | | | 951,250 | 927,140 | 0.27 |
| | | 合計: ドイツ | 2,740,089 | 2,566,562 | 0.75 |
| 変動金利債 | | | | | |
| ガーンジー島 | | | | | |
| USD | 400,000 | CREDIT SUISSE GUERNSEY FRN 11/12/49 | 426,333 | 421,488 | 0.12 |
| | | | 426,333 | 421,488 | 0.12 |
| | | 合計: ガーンジー島 | 426,333 | 421,488 | 0.12 |
| 国債 | | | | | |
| インドネシア | | | | | |
| USD | 200,000 | REP OF INDONES 5.375% 17/10/23 REGS | 213,064 | 208,810 | 0.06 |
| | | | 213,064 | 208,810 | 0.06 |
| | | 合計: インドネシア | 213,064 | 208,810 | 0.06 |
| 変動金利債 | | | | | |
| アイルランド | | | | | |
| USD | 200,000 | ARDAGH PKG FIN FRN 15/12/19 144A | 197,875 | 193,640 | 0.06 |
| | | | 197,875 | 193,640 | 0.06 |
| 国債 | | | | | |
| EUR | 1,250,000 | IRISH GVT 2.4% 15/05/30 | 1,524,401 | 1,492,402 | 0.43 |
| EUR | 500,000 | IRISH GVT 3.4% 18/03/24 | 647,239 | 650,916 | 0.19 |
| | | | 2,171,640 | 2,143,318 | 0.62 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 406,000 | GRIFOLS WORLDWIDE 5.25% 01/04/22 | 412,235 | 410,568 | 0.13 |
| EUR | 225,000 | ARDAGH PACK 9.25% 15/10/20 REGS | 296,903 | 257,156 | 0.08 |
| USD | 200,000 | ARDAGH PACKAGING 9.125% 15/10/20 14 | 215,500 | 206,000 | 0.06 |
| USD | 200,000 | JAMES HARDIE 5.875% 15/02/23 144A | 198,426 | 204,000 | 0.06 |
| USD | 150,000 | AERCAP IRELAND 4.25% 01/07/20 | 150,000 | 151,500 | 0.04 |
| USD | 50,000 | ALLEGION PLC 5.875% 15/09/23 | 50,000 | 51,000 | 0.01 |
| | | | 1,323,064 | 1,280,224 | 0.38 |
| | | 合計: アイルランド | 3,692,579 | 3,617,182 | 1.06 |
| 国債 | | | | | |
| イタリア | | | | | |
| EUR | 560,000 | BTPS 2.35% 15/09/19 | 746,804 | 743,093 | 0.22 |
| EUR | 310,000 | BTPS 2.5% 01/12/24 | 365,941 | 368,226 | 0.11 |
| EUR | 290,000 | BTPS 0.65% 01/11/20 | 318,035 | 317,566 | 0.09 |
| EUR | 250,000 | BTPS 3.75% 01/05/21 | 311,158 | 316,711 | 0.09 |
| EUR | 220,000 | BTPS 2.1% 15/09/16 | 270,773 | 261,170 | 0.08 |
| EUR | 200,000 | REP OF ITALY 2% 01/12/25 | 228,619 | 226,512 | 0.07 |
| EUR | 170,000 | BTPS 3.75% 01/03/21 | 216,619 | 214,740 | 0.06 |
| EUR | 100,000 | BTPS 2.55% 15/09/41 | 146,100 | 149,223 | 0.04 |
| | | | 2,604,049 | 2,597,241 | 0.76 |
| | | 合計: イタリア | 2,604,049 | 2,597,241 | 0.76 |

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| ルクセンブルグ | | | | | |
| ペイ・イン・カインド(PIK)債 | | | | | |
| USD | 355,512 | ARDAGH FIN PIK 8.625% 15/06/19 144A | 318,479 | 350,179 | 0.10 |
| USD | 25,000 | CAPSUGEL SA PIK 7% 15/05/19 144A | 25,438 | 24,438 | 0.01 |
| | | | 343,917 | 374,617 | 0.11 |
| ステップアップ/ダウン債 | | | | | |
| USD | 579,000 | ARCELORMITTAL 7% 15/10/39 | 588,616 | 395,168 | 0.11 |
| USD | 100,000 | ARCELORMITTAL 5.5% 01/03/21 | 101,000 | 79,500 | 0.02 |
| USD | 25,000 | ARCELORMITTAL STUP 01/06/19 | 31,281 | 23,500 | 0.01 |
| USD | 29,000 | ARCELORMITTAL STUP 25/02/22 | 28,110 | 23,345 | 0.01 |
| | | | 749,007 | 521,513 | 0.15 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 800,000 | EFSF 0.75% 05/06/17 EMTN | 899,819 | 886,501 | 0.25 |
| USD | 1,750,000 | INTELSAT LUX 8.125% 01/06/23 | 1,841,187 | 796,250 | 0.23 |
| USD | 814,000 | WIND ACQUIS FIN 7.375% 23/04/21 144 | 798,884 | 769,230 | 0.23 |
| USD | 525,000 | MALLINCKRODT INTL 4.75% 15/04/23 | 494,102 | 468,563 | 0.14 |
| USD | 305,000 | INTEL JACKSON 7.25% 01/04/19 | 320,764 | 279,075 | 0.08 |
| USD | 264,000 | MALLINCKRODT FIN 5.75% 1/8/22 144A | 268,434 | 254,760 | 0.07 |
| USD | 200,000 | ALTICE FIN SA 6.625% 15/02/23 144A | 200,000 | 198,000 | 0.06 |
| USD | 200,000 | INEOS GROUP HDGS 6.125% 15/08/18 14 | 205,000 | 198,000 | 0.06 |
| USD | 200,000 | CONSOLIDATED NRG 6.75% 15/10/19 144 | 198,000 | 191,500 | 0.06 |
| USD | 200,000 | COVERIS HDGS SA 7.875% 01/11/19 144 | 204,400 | 178,000 | 0.05 |
| USD | 200,000 | ALTICE SA 7.625% 15/02/23 144A | 200,000 | 173,000 | 0.05 |
| GBP | 100,000 | EIB 3.875% 08/06/37 EMTN | 187,719 | 171,208 | 0.05 |
| USD | 175,000 | INTELSAT JACK 5.5% 01/08/23 | 150,563 | 137,375 | 0.04 |
| USD | 125,000 | ACTAVIS FUNDING 3.8% 15/03/25 | 125,406 | 124,017 | 0.04 |
| USD | 120,000 | INTELSAT JACKSON 7.5% 01/04/21 | 127,113 | 104,100 | 0.03 |
| USD | 100,000 | BEVERAGE PACK 5.625% 15/12/16 144A | 101,750 | 98,875 | 0.03 |
| USD | 100,000 | MALLINCKRODT FIN 5.5% 15/04/25 144A | 100,000 | 92,000 | 0.03 |
| USD | 42,000 | MALLINCKRODT FIN 4.875% 15/04/20 14 | 42,000 | 40,320 | 0.01 |
| USD | 25,000 | ACTAVIS FUNDING 4.75% 15/03/45 | 23,758 | 24,273 | 0.01 |
| USD | 25,000 | BEVERAGE PACKAGING 6% 15/6/17 144A | 25,219 | 24,156 | 0.01 |
| USD | 25,000 | INTELSAT JACK 7.25% 15/10/20 GDT | 25,313 | 21,700 | 0.01 |
| USD | 25,000 | INTELSAT LUX 7.75% 01/06/21 | 20,250 | 11,625 | 0.00 |
| | | | 6,559,681 | 5,242,528 | 1.54 |
| | | 合計: ルクセンブルグ | 7,652,605 | 6,138,658 | 1.80 |
| マーシャル諸島 | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 150,000 | NAVIOS MARITIME 8.125% 15/11/21 144 | 153,625 | 130,875 | 0.04 |
| | | | 153,625 | 130,875 | 0.04 |
| | | 合計: マーシャル諸島 | 153,625 | 130,875 | 0.04 |
| メキシコ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| MXN | 150,000 | MEXICAN BONOS DES 6.5% 9/06/22 M | 1,118,651 | 893,875 | 0.27 |
| MXN | 125,200 | MEXICAN BONOS DES 7.75% 13/11/42 M | 993,181 | 788,852 | 0.24 |
| MXN | 90,000 | MEXICAN BONOS DES 4.75% 14/06/18 M | 664,958 | 523,331 | 0.15 |
| MXN | 60,000 | MEXICAN BONOS DES 8.5% 31/5/29 M | 533,837 | 405,597 | 0.12 |
| USD | 20,000 | UNITED MEXICAN STATE 5.55% 21/01/45 | 21,675 | 20,450 | 0.01 |
| USD | 10,000 | UTD MEXICAN STATE 6.05% 11/01/40 | 11,590 | 10,950 | 0.00 |
| USD | 10,000 | UTD MEXICAN STATE 4.75% 8/3/44 MTN | 9,530 | 9,125 | 0.00 |
| | | | 3,353,422 | 2,652,180 | 0.79 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 200,000 | CEMEX SAB DE CV 5.7% 11/1/25 144A | 200,001 | 167,426 | 0.05 |

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

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-------------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| USD | 170,000 | GRUPO BIMBO SAB 4.875% 27/06/44 144 | 169,885 | 148,056 | 0.04 |
| MXN | 66,330 | MEXICAN CETES 0% 28/01/16 BI | 39,734 | 38,288 | 0.01 |
| | | | 409,620 | 353,770 | 0.10 |
| 短期国庫債券 | | | | | |
| MXN | 1,025,979 | MEXICAN CETES 0% 21/01/16 BI | 608,383 | 592,556 | 0.17 |
| MXN | 780,274 | MEXICO CETES 0% 17/03/16 BI | 446,187 | 448,383 | 0.13 |
| MXN | 663,082 | MEXICO CETES 0% 18/02/16 BI | 391,988 | 381,997 | 0.11 |
| MXN | 571,605 | MEXICO CETES 0% 10/03/16 BI | 335,277 | 327,992 | 0.10 |
| MXN | 341,410 | MEXICAN CETES 0% 03/03/16 BI | 204,332 | 196,435 | 0.06 |
| | | | 1,986,167 | 1,947,363 | 0.57 |
| | | 合計: メキシコ | 5,749,209 | 4,953,313 | 1.46 |
| オランダ | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 600,000 | ABN AMRO BK 6.25% 13/09/22 EMTN | 655,861 | 629,092 | 0.19 |
| USD | 350,000 | ING BANK NV FRN 21/11/23 EMTN | 356,761 | 356,825 | 0.10 |
| USD | 200,000 | ING GROEP NV FRN 31/12/49 | 200,000 | 195,500 | 0.06 |
| EUR | 100,000 | ABN AMRO BANK FRN 29/03/49 | 128,863 | 109,488 | 0.03 |
| | | | 1,341,485 | 1,290,905 | 0.38 |
| 国債 | | | | | |
| EUR | 300,000 | NETHERLANDS GVT 1.75% 15/07/23 | 409,024 | 359,795 | 0.11 |
| | | | 409,024 | 359,795 | 0.11 |
| ペイ・イン・カインド(PIK)債 | | | | | |
| USD | 200,000 | SCHAEFFLER PIK 6.25% 15/11/19 144A | 202,625 | 209,000 | 0.06 |
| USD | 150,000 | JLL/DELTA DUTCH PIK 9.5% 1/5/20 144 | 150,000 | 144,750 | 0.04 |
| | | | 352,625 | 353,750 | 0.10 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| EUR | 450,000 | RABOBANK NED 3.875% 25/07/23 | 639,508 | 544,033 | 0.17 |
| USD | 375,000 | CONSTELLUM NV 5.75% 15/05/24 144A | 312,187 | 255,000 | 0.08 |
| USD | 250,000 | LBC TANK TERM 6.875% 15/05/23 144A | 263,750 | 247,500 | 0.07 |
| USD | 200,000 | SCHAEFFLER FIN 4.75% 15/05/21 144A | 200,000 | 201,000 | 0.06 |
| USD | 200,000 | ZIGGO BONG FIN 5.875% 15/01/25 144A | 200,000 | 185,500 | 0.05 |
| USD | 200,000 | MARFRIG HLDG EUR 6.875% 24/6/19 14 | 203,500 | 179,500 | 0.05 |
| EUR | 100,000 | BAYER CAP CORP 1.25% 13/11/23 EMTN | 123,258 | 110,802 | 0.03 |
| | | | 1,942,203 | 1,723,335 | 0.51 |
| | | 合計: オランダ | 4,045,337 | 3,727,785 | 1.10 |
| ニュージーランド | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| NZD | 3,007,000 | NEW ZEAL GVT 4.5% 15/04/27 0427 | 2,208,861 | 2,236,827 | 0.66 |
| NZD | 170,000 | NEW ZEAL GVT 2.5% 20/09/35 CPI | 138,161 | 115,795 | 0.03 |
| | | | 2,347,022 | 2,352,622 | 0.69 |
| | | 合計: ニュージーランド | 2,347,022 | 2,352,622 | 0.69 |
| ポーランド | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| PLN | 5,000,000 | POLAND GVT BOND 5.75% 25/10/21 1021 | 1,566,192 | 1,521,514 | 0.44 |
| PLN | 2,500,000 | POLAND GVT BOND 5.75% 23/09/22 0922 | 778,499 | 767,676 | 0.23 |
| | | | 2,344,691 | 2,289,190 | 0.67 |
| | | 合計: ポーランド | 2,344,691 | 2,289,190 | 0.67 |

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|---------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| プエルトリコ | | | | | |
| ステップアップ/ダウン債 | | | | | |
| USD | 210,000 | PUERTO RICO SALES 0% 01/08/32 | 157,917 | 82,288 | 0.02 |
| | | | 157,917 | 82,288 | 0.02 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 240,000 | PUERTO RICO CMLWTH 8% 01/07/35 | 210,727 | 171,599 | 0.05 |
| USD | 245,000 | PUERTO RICO SALES FIRS 5.25% 1/8/41 | 163,847 | 97,999 | 0.03 |
| USD | 95,000 | PUERTO RICO CMLW SERA 5.375% 1/7/33 | 74,456 | 59,909 | 0.02 |
| USD | 80,000 | PUERTO RICO CMLWTH SERA 5.5% 1/7/26 | 65,300 | 51,099 | 0.02 |
| USD | 270,000 | PUERTO RICO SALES 0% 01/08/34 | 46,842 | 28,931 | 0.01 |
| USD | 65,000 | PUERTO RICO SALES TAX 6% 01/08/42 | 53,666 | 26,813 | 0.01 |
| USD | 35,000 | PUERTO RICO CMLWTH IMP 5.75% 1/7/41 | 27,431 | 22,356 | 0.01 |
| USD | 55,000 | PUERTO RICO SALES 5.5% 01/08/42 | 38,981 | 22,138 | 0.01 |
| USD | 45,000 | PUERTO RICO SALES TAX 5.25% 1/08/27 | 34,998 | 19,069 | 0.01 |
| USD | 20,000 | PUERTO RICO AQUE 5.25% 01/07/42 | 14,106 | 13,000 | 0.00 |
| USD | 25,000 | PUERTO RICO SALES TAX 5.5% 01/08/37 | 20,442 | 10,063 | 0.00 |
| USD | 20,000 | PUERTO RICO SALES 5% 01/08/43 | 9,546 | 8,000 | 0.00 |
| USD | 10,000 | PUERTO RICO AQUE 5% 01/07/33 | 6,969 | 6,500 | 0.00 |
| USD | 15,000 | PUERTO RICO SALES TAX 5.5% 01/08/28 | 11,719 | 6,375 | 0.00 |
| USD | 10,000 | PUERTO RICO CMLWTH 5.5% 01/07/32 | 7,000 | 6,338 | 0.00 |
| USD | 15,000 | PUERTO RICO SALES TAX 6% 01/08/39 | 12,480 | 6,188 | 0.00 |
| USD | 15,000 | PUERTO RICO SALES TAX 5.75% 1/08/37 | 12,576 | 6,113 | 0.00 |
| USD | 15,000 | PUERTO RICO SALES TAX 5% 01/08/35 C | 11,464 | 6,000 | 0.00 |
| USD | 5,000 | PUERTO RICO CMLWTH 5.5% 01/07/28 | 3,698 | 3,375 | 0.00 |
| USD | 5,000 | PUERTO RICO SALES TAX 5.375% 1/8/36 | 3,934 | 2,000 | 0.00 |
| USD | 5,000 | PUERTO RICO SALES 5.25% 01/08/43 | 3,465 | 2,000 | 0.00 |
| USD | 5,000 | PUERTO RICO SALES TAX 5.375% 1/8/39 | 3,880 | 2,000 | 0.00 |
| | | | 837,527 | 577,865 | 0.17 |
| | | 合計: プエルトリコ | 995,444 | 660,153 | 0.19 |
| 韓国 | | | | | |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 800,000 | KOREA DEVEL BK 3% 14/09/22 | 794,056 | 804,204 | 0.24 |
| USD | 700,000 | EXP-IMP BK KOREA 4% 29/01/21 | 743,370 | 746,072 | 0.22 |
| | | | 1,537,426 | 1,550,276 | 0.46 |
| | | 合計: 韓国 | 1,537,426 | 1,550,276 | 0.46 |
| シンガポール | | | | | |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 700,000 | UTD OVERSEAS BK FRN 19/09/24 EMTN | 705,361 | 709,044 | 0.21 |
| USD | 300,000 | DBS BK SINGAPORE FRN 21/09/22 REGS | 309,962 | 305,196 | 0.09 |
| | | | 1,015,323 | 1,014,240 | 0.30 |
| | | 合計: シンガポール | 1,015,323 | 1,014,240 | 0.30 |
| スロベニア | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| EUR | 1,000,000 | REP OF SLOVENIA 2.25% 25/03/22 | 1,151,180 | 1,173,070 | 0.34 |
| | | | 1,151,180 | 1,173,070 | 0.34 |
| | | 合計: スロベニア | 1,151,180 | 1,173,070 | 0.34 |
| 南アフリカ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| ZAR | 7,700,000 | REP OF STH AFRICA 6.5% 28/2/41 R214 | 521,835 | 331,813 | 0.10 |
| | | | 521,835 | 331,813 | 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(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 400,000 | KOREA WATER RES 2% 16/04/18 | 399,544 | 396,916 | 0.11 |
| | | | 399,544 | 396,916 | 0.11 |
| | | 合計: 南アフリカ | 921,379 | 728,729 | 0.21 |
| スペイン | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| EUR | 440,000 | SPANISH GVT 5.5% 30/04/21 | 595,020 | 598,508 | 0.18 |
| EUR | 410,000 | BONOS Y OBLIG DE EST 1.15% 30/07/20 | 448,516 | 457,834 | 0.13 |
| EUR | 210,000 | SPANISH GVT 2.75% 31/10/24 | 247,884 | 250,589 | 0.07 |
| EUR | 170,000 | SPANISH GOV'T 0.55% 30/11/19 CPI | 190,641 | 191,110 | 0.06 |
| EUR | 90,000 | SPANISH GVT 5.15% 31/10/44 | 137,760 | 139,497 | 0.04 |
| EUR | 100,000 | KINGDOM OF SPAIN 2.15% 31/10/25 | 112,508 | 112,989 | 0.03 |
| | | | 1,732,329 | 1,750,527 | 0.51 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 200,000 | ABENGOA GREENFIELD 6.5% 01/10/19 14 | 200,000 | 22,000 | 0.01 |
| | | | 200,000 | 22,000 | 0.01 |
| | | 合計: スペイン | 1,932,329 | 1,772,527 | 0.52 |
| スリランカ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 220,000 | REP OF SRI LANKA 6.125% 3/6/25 REGS | 208,175 | 195,595 | 0.06 |
| | | | 208,175 | 195,595 | 0.06 |
| | | 合計: スリランカ | 208,175 | 195,595 | 0.06 |
| スウェーデン | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| SEK | 500,000 | SWEDISH GVT 2.5% 12/05/25 1058 | 70,196 | 67,840 | 0.02 |
| SEK | 500,000 | SWEDISH GVT 1.5% 13/11/23 1057 | 70,257 | 62,903 | 0.02 |
| | | | 140,453 | 130,743 | 0.04 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 200,000 | PERSTORP HDGS AB 8.75% 15/05/17 144 | 211,500 | 198,000 | 0.06 |
| | | | 211,500 | 198,000 | 0.06 |
| | | 合計: スウェーデン | 351,953 | 328,743 | 0.10 |
| イギリス | | | | | |
| 資産担保証券 | | | | | |
| USD | 500,000 | ARES 07-12A A CLO FRN 25/11/20 | 182,998 | 183,049 | 0.05 |
| | | | 182,998 | 183,049 | 0.05 |
| モーゲージ担保証券 | | | | | |
| USD | 1,200,000 | SMI 15-1X 2A2 FRN 21/01/70 REGS | 1,200,000 | 1,199,071 | 0.35 |
| GBP | 200,000 | ESAIL 07-PR1X FRN 13/09/45 | 116,482 | 102,299 | 0.03 |
| | | | 1,316,482 | 1,301,370 | 0.38 |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 401,000 | BARCLAYS COLLAT FRN 11/03/16 11-1 | 401,000 | 400,736 | 0.12 |
| USD | 350,000 | RBS FRN 29/03/49 U | 370,750 | 366,117 | 0.11 |
| USD | 250,000 | RBS FRN 16/3/22 | 282,600 | 269,331 | 0.08 |
| USD | 200,000 | BARCLAYS BK PLC FRN 29/12/49 | 200,500 | 213,460 | 0.06 |
| GBP | 100,000 | LLOYDS BANK FRN 16/12/21 EMTN | 181,570 | 161,367 | 0.05 |
| USD | 135,000 | HSBC HOLDINGS FRN 29/12/49 | 135,000 | 135,273 | 0.04 |
| EUR | 75,000 | RBS FRN 16/03/22 EMTN | 112,452 | 91,256 | 0.03 |

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| USD | 50,000 | BARCLAYS PLC FRN 30/06/49 | 48,625 | 49,207 | 0.01 |
| | | | 1,732,497 | 1,686,747 | 0.50 |
| 国債 | | | | | |
| GBP | 10,000 | UK TREAS GILT 3.25% 22/01/44 | 16,967 | 16,404 | 0.00 |
| | | | 16,967 | 16,404 | 0.00 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| GBP | 350,000 | HSBC HLDGS PLC 6.75% 11/09/28 | 675,916 | 621,639 | 0.19 |
| USD | 500,000 | BARCLAYS BANK PLC 7.625% 21/11/22 | 548,125 | 569,375 | 0.17 |
| USD | 600,000 | CEVA GROUP PLC 7% 01/03/21 144A | 595,875 | 498,000 | 0.15 |
| USD | 300,000 | HSBC HLDGS PLC 6.8% 01/06/38 | 369,858 | 372,208 | 0.11 |
| USD | 405,000 | INTL GAME 6.5% 15/02/25 144A | 395,605 | 355,388 | 0.10 |
| EUR | 200,000 | ASTRAZENECA 0.875% 24/11/21 EMTN | 248,174 | 219,414 | 0.06 |
| USD | 200,000 | VIRGIN MEDIA FIN 5.75% 15/01/25 144 | 201,688 | 192,500 | 0.06 |
| USD | 200,000 | INTL GAME 6.25% 15/02/22 144A | 200,000 | 187,000 | 0.05 |
| EUR | 100,000 | LLOYDS BANK 1% 19/11/21 EMTN | 123,706 | 108,798 | 0.03 |
| | | | 3,358,947 | 3,124,322 | 0.92 |
| | | 合計: イギリス | 6,607,891 | 6,311,892 | 1.85 |
| アメリカ | | | | | |
| 資産担保証券 | | | | | |
| USD | 1,050,000 | HLA 2015- 2A A CLO FRN 25/07/27 | 1,039,339 | 1,029,150 | 0.31 |
| USD | 1,000,000 | ZCCP 2015 1A ACOM CLO FRN 16/07/27 | 983,335 | 970,899 | 0.30 |
| USD | 400,000 | OFSBS 2013- 5A A2L CLO FRN 17/04/25 | 399,999 | 390,075 | 0.11 |
| USD | 440,000 | POPLR 05-4 M1 FRN 25/09/35 | 379,499 | 388,369 | 0.11 |
| USD | 730,000 | AMSI 04-R3 M1 FRN 25/05/34 | 382,618 | 387,294 | 0.11 |
| USD | 440,000 | CARR 05-NC5 M1 FRN 25/10/35 | 381,149 | 386,506 | 0.11 |
| USD | 420,000 | INABS M3-05B FRN 25/08/35 | 381,413 | 386,077 | 0.11 |
| USD | 465,000 | GSAMP 06-HE1 M1 FRN 25/01/36 | 384,788 | 377,574 | 0.11 |
| USD | 425,000 | RAMP 06 RZ1 M3 FRN 25/03/36 | 339,469 | 356,241 | 0.10 |
| USD | 307,332 | MSAC 05-HE3 M4 FRN 25/07/35 | 266,611 | 273,625 | 0.08 |
| USD | 1,000,000 | ELAT 07-2 A2E FRN 25/05/37 | 255,296 | 265,083 | 0.08 |
| USD | 500,000 | SLMA 03-1 A5A FRN 15/12/32 | 261,265 | 261,188 | 0.08 |
| USD | 285,000 | SVHE 05-2 M5 FRN 25/07/35 | 252,225 | 260,731 | 0.08 |
| USD | 290,000 | SVHE 05-OPT1 M2 FRN 25/06/35 | 253,750 | 255,904 | 0.08 |
| USD | 250,000 | PARL 15-1A A FRN 20/07/27 | 249,350 | 244,911 | 0.07 |
| USD | 280,000 | JPMAC 05-OPT2 M2 FRN 25/12/35 | 248,500 | 244,256 | 0.07 |
| USD | 250,000 | SLMA 2007-1 A5 FRN 26/01/26 | 238,047 | 238,462 | 0.07 |
| USD | 280,000 | HASC 06-OPT2 M2 FRN 25/01/36 | 228,900 | 231,724 | 0.07 |
| USD | 250,000 | RASC 05-KS12 M2 FRN 25/01/36 | 211,250 | 205,743 | 0.06 |
| USD | 200,000 | SLMA 2008-5 A4 FRN 25/07/23 | 200,781 | 200,778 | 0.06 |
| USD | 200,000 | SPART 15-T2 AT2 2.62% 15/01/47 | 199,984 | 199,984 | 0.06 |
| USD | 190,000 | CWL 05-AB1 M1FRN 25/08/35 | 169,100 | 172,947 | 0.05 |
| USD | 250,000 | FCLO 6A A CLO FRN 09/08/19 | 170,438 | 169,436 | 0.05 |
| USD | 230,000 | SVHE 07-1 2A3 FRN 25/03/37 | 150,004 | 154,605 | 0.05 |
| USD | 165,000 | FHLT 05-2 M3 FRN 25/06/35 | 142,313 | 143,160 | 0.04 |
| USD | 160,000 | SVHE 06-1 A4 FRN 25/02/36 | 140,400 | 142,057 | 0.04 |
| USD | 200,000 | NSLT 2005-4 A3 FRN 22/06/26 | 137,327 | 137,062 | 0.04 |
| USD | 510,000 | HEMT 04-5 M2 FRN 25/02/35 | 135,027 | 134,030 | 0.04 |
| USD | 150,000 | JPMAC 07-CH1 MV2 FRN 25/11/36 | 127,875 | 131,935 | 0.04 |
| USD | 150,000 | FBRSI 05-2 M2 FRN 25/09/35 | 131,438 | 131,200 | 0.04 |
| USD | 150,000 | BSABS 05-AQ2 M1 FRN 25/09/35 | 132,938 | 129,290 | 0.04 |
| USD | 150,000 | JPMAC 07-CH2 AV5 FRN 25/01/37 | 117,281 | 117,139 | 0.03 |
| USD | 150,000 | GSAMP 06-HE8 A2C FRN 25/01/37 | 125,438 | 117,033 | 0.03 |
| USD | 200,000 | HELT 2007-FRE1 2A FRN 25/04/37 | 122,000 | 116,277 | 0.03 |
| USD | 131,000 | CMLTI 06-WFH4 M1 FRN 25/11/36 | 109,385 | 106,939 | 0.03 |
| USD | 100,000 | SLMA 08-4 A4 FRN 25/07/22 | 100,635 | 100,473 | 0.03 |
| USD | 100,000 | HEF 2005-1 A4 FRN 25/02/30 | 98,188 | 98,416 | 0.03 |

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|--------|----------------------------|--------------------------------------|------------|------------|---------|
| USD | 120,000 | AMIT 2005-4 M3 FRN 25/10/35 | 96,600 | 96,263 | 0.03 |
| USD | 110,000 | VOLT 15-NPL8 A1 3.5% 26/06/45 | 96,669 | 95,462 | 0.03 |
| USD | 200,000 | ACE 06-ASP4 A2C FRN 25/08/36 | 89,922 | 93,632 | 0.03 |
| USD | 100,000 | SLMA 05-4 A3 FRN 25/01/27 | 89,135 | 89,098 | 0.03 |
| USD | 100,000 | SLMA 08-2 A3 FRN 25/04/23 | 84,840 | 84,624 | 0.02 |
| USD | 200,000 | GSA 07-5 2A2A FRN 25/04/47 | 81,842 | 84,122 | 0.02 |
| USD | 100,000 | JPMAC 06-CH1 M1 FRN 25/07/36 | 82,000 | 83,122 | 0.02 |
| USD | 100,000 | CARR 06-RFC1 A4 FRN 25/05/36 | 80,375 | 82,390 | 0.02 |
| USD | 200,000 | SCHOL 10-A A FRN 28/10/41 | 81,605 | 81,697 | 0.02 |
| USD | 270,000 | PPSI 04-WHQ1 M4 FRN 25/09/34 | 51,366 | 52,118 | 0.02 |
| USD | 100,000 | SLMA 2003-14 A5 FRN 25/01/23 | 42,920 | 42,983 | 0.01 |
| USD | 150,000 | ACSS 2006-1 A2 FRN 25/08/23 | 30,569 | 30,654 | 0.01 |
| USD | 100,000 | GOAL 2006-1 A3 FRN 25/11/26 | 23,368 | 23,459 | 0.01 |
| USD | 100,000 | SLMA 2006-9 A4 FRN 25/10/22 | 19,434 | 19,478 | 0.01 |
| | | | 10,598,000 | 10,615,675 | 3.12 |
| バンクローン | | | | | |
| USD | 2,563,958 | TIBCO SOFTWARE FRN 25/11/20 TL | 2,466,465 | 2,336,406 | 0.70 |
| USD | 1,765,855 | BURGER KING/TIM FRN 10/12/21 TL B2 | 1,758,600 | 1,751,286 | 0.52 |
| USD | 1,729,862 | ALBERTSON'S FRN 25/08/21 TB4 | 1,720,425 | 1,717,977 | 0.51 |
| USD | 1,577,653 | SERVICEMASTER FRN 16/6/21 INIT TL | 1,566,901 | 1,562,664 | 0.47 |
| USD | 2,150,000 | CLEAR CHANNEL COM FRN 30/07/19 TE01 | 2,140,874 | 1,507,687 | 0.45 |
| USD | 1,490,006 | ALTICE FIN \$ DEN FRN 30/1/22 TL05 | 1,475,105 | 1,486,750 | 0.45 |
| USD | 1,706,631 | CERIDIAN CORP FRN 15/9/20 REPS1STTL | 1,701,146 | 1,459,168 | 0.44 |
| USD | 1,481,259 | TRAVEL PORT FRN 15/08/21 TL01 | 1,477,092 | 1,453,485 | 0.44 |
| USD | 1,450,629 | US FOODSERVICE FRN 31/03/19 TL01 | 1,447,870 | 1,435,215 | 0.42 |
| USD | 1,346,625 | COMMUNICATIONS SAL FRN 16/10/22 TL1 | 1,319,692 | 1,249,000 | 0.37 |
| USD | 1,250,000 | ENERGY FUT DIP/TXU FRN 19/06/16 TL | 1,251,562 | 1,247,813 | 0.37 |
| USD | 1,250,000 | METRO GOLDWYN FRN 26/6/20 2NDL TL01 | 1,248,124 | 1,246,875 | 0.37 |
| USD | 1,274,565 | ADVANTAGE SAL FRN 23/7/21 INIT 1STL | 1,255,522 | 1,228,764 | 0.36 |
| USD | 1,226,778 | KINETIC CONCEPTS FRN 4/5/18 \$ TE1 | 1,222,177 | 1,186,294 | 0.35 |
| USD | 1,237,500 | GATES GLOBAL FRN 12/6/21 INITS TL01 | 1,222,649 | 1,164,537 | 0.34 |
| USD | 1,125,000 | ENDO 15 FRN 24/06/22 INCR TB01 | 1,121,438 | 1,111,292 | 0.33 |
| USD | 1,129,923 | BWAY HOLD FRN 08/08/20 INIT TL01 | 1,133,309 | 1,088,963 | 0.32 |
| USD | 1,075,000 | FIRST DATA CORP FRN 08/07/22 \$ TL | 1,069,438 | 1,061,729 | 0.31 |
| USD | 1,045,455 | ZEBRA TECHNO FRN INIT 27/10/21 TL01 | 1,037,614 | 1,048,120 | 0.31 |
| USD | 988,737 | GO DADDY OPER FRN 13/05/21 INITL | 982,869 | 984,071 | 0.29 |
| USD | 991,881 | AMERICAN TIRE FRN 24/9/21 INIT TL | 986,922 | 982,582 | 0.29 |
| USD | 1,126,834 | CARECORE NTL INIT FRN 05/03/21 TL01 | 1,118,383 | 980,345 | 0.29 |
| USD | 994,975 | CENGAGE LEARN FRN 06/03/20 TL01 | 988,632 | 972,588 | 0.29 |
| USD | 1,000,000 | INFORMATICA DOLLAR FRN 30/6/22 TL | 997,500 | 964,790 | 0.28 |
| USD | 988,929 | BRICKMAN FRN 18/12/20 INITL 1STL | 971,616 | 960,686 | 0.28 |
| USD | 966,656 | EQUINOX HLDG FRN 31/01/20 NEW TB01 | 964,952 | 958,603 | 0.28 |
| USD | 992,500 | GOBP/GROCERY FRN 21/10/21 1STINITL | 985,118 | 957,763 | 0.28 |
| USD | 962,222 | MATTRESS HDGS FRN 01/10/21 TL | 956,028 | 955,405 | 0.28 |
| USD | 995,420 | ACOSTA INC FRN 26/09/21 INIT TL | 991,667 | 949,800 | 0.28 |
| USD | 988,278 | SEARS HLDG FRN 30/06/18 TL01 | 964,124 | 931,452 | 0.27 |
| USD | 935,000 | EYEMART EXP LLC FRN 16/12/21 TL | 930,325 | 919,806 | 0.27 |
| USD | 968,579 | INFOR US FRN 03/06/20 TB501 | 953,503 | 911,878 | 0.27 |
| USD | 1,087,268 | OPAL ACQ FRN 21/11/20 1ST TB | 1,085,413 | 908,771 | 0.27 |
| USD | 901,475 | LANDMARK AV FRN 25/10/19 US 1STL01 | 898,504 | 898,942 | 0.26 |
| USD | 900,000 | FIRST DATA FRN 24/03/18 2018 \$ TL01 | 891,613 | 889,947 | 0.26 |
| USD | 890,977 | DAVITA HEALTHCARE FRN 02/06/21 TB | 887,636 | 889,120 | 0.26 |
| USD | 939,072 | HUB INTL LTD FRN 02/10/20 INIT TL01 | 931,800 | 888,597 | 0.26 |
| USD | 860,318 | AVAGO NEW HOLD FRN 16/04/21 TL | 859,619 | 858,348 | 0.25 |
| USD | 895,902 | COMPUWARE CORP FRN 11/12/21 TB201 | 851,107 | 838,040 | 0.25 |
| USD | 851,564 | NORD ANGLIA EDUC FRN 31/3/21 1STTL | 846,523 | 834,532 | 0.25 |
| USD | 841,727 | CONNOLLY FRN 14/05/21 ST TL | 838,943 | 816,476 | 0.24 |
| USD | 843,244 | NATIONAL FIN PART FRN 01/07/20 TL | 839,153 | 811,973 | 0.24 |
| USD | 835,243 | BJS WHOLESALE FRN 26/9/19 1ST TL | 826,669 | 802,877 | 0.24 |

| 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 | 843,043 | WARNER MUSI/WMG ACQ FRN 1/7/20 TB01 | 814,412 | 801,418 | 0.24 |
| USD | 814,758 | HARLAN CLARKE FRN 30/06/17 B2 TL02 | 817,280 | 790,315 | 0.23 |
| USD | 787,279 | SUPERVALU FRN 21/03/19 TL | 782,605 | 778,422 | 0.23 |
| USD | 767,684 | MA FINANCE/MICRO FRN 7/10/21 TBLT01 | 733,138 | 761,734 | 0.22 |
| USD | 750,000 | RITE AID CORP FRN 21/8/20 2ND TL1 | 752,813 | 752,531 | 0.22 |
| USD | 750,000 | DELOS INTL LEASE FRN 27/02/21 TL | 746,250 | 748,864 | 0.22 |
| USD | 750,000 | CITYCENTER HDGS FRN 09/10/20 TB01 | 750,938 | 744,750 | 0.22 |
| USD | 750,000 | LEVEL 3 FIN FRN 31/05/22 TB | 744,375 | 739,451 | 0.22 |
| USD | 743,676 | ALERE FRN 03/06/22 TB | 741,817 | 738,411 | 0.22 |
| USD | 964,636 | CUMULUS MEDIA FRN 19/12/20 TL01 | 954,941 | 737,946 | 0.22 |
| USD | 744,375 | PRO MACH GRP FRN 15/10/21 1ST \$ TL | 736,931 | 737,549 | 0.22 |
| USD | 740,626 | CATALENT PHARMA FRN 20/05/21 \$ TL | 740,626 | 735,997 | 0.22 |
| USD | 741,176 | ZAYO GROUP LLC FRN 02/07/19 TB | 735,000 | 730,718 | 0.21 |
| USD | 732,475 | DELL INTL FRN 29/04/20 TB201 | 731,660 | 727,769 | 0.21 |
| USD | 730,253 | PRESTIGE FRN 03/09/21 TB03 | 726,602 | 727,668 | 0.21 |
| USD | 742,829 | ALLIED SEC FRN 12/02/21 1ST TL01 | 731,686 | 724,258 | 0.21 |
| USD | 750,000 | VALEANT FRN 05/08/20 E1 TB TL01 | 747,500 | 722,063 | 0.21 |
| USD | 725,000 | U AVAGO TECHNO CAY FRN 11/11/22 TB | 717,688 | 718,595 | 0.21 |
| USD | 715,425 | SIG COMBIBLOC FRN 03/02/22 \$ TL01 | 711,848 | 705,781 | 0.21 |
| USD | 742,481 | ATKORE INTL FRN 09/04/21 1ST TL01 | 738,769 | 696,076 | 0.20 |
| USD | 741,244 | FITNESS INT FRN 01/07/20 TL B | 736,919 | 686,885 | 0.20 |
| USD | 700,565 | MICRO HLDG FRN 08/07/21 INIT 1STL01 | 697,454 | 682,466 | 0.20 |
| USD | 663,490 | NUMERICABLE US FRN 21/5/20 TB1 | 662,329 | 641,605 | 0.19 |
| USD | 643,062 | MEDIA GENERAL FRN 30/07/20 TBL01 | 635,024 | 636,632 | 0.19 |
| USD | 670,061 | YORK RISK SVC FRN 1/10/21 INIT TL | 664,525 | 635,302 | 0.19 |
| USD | 646,750 | LIFE TIME FRN 15/04/22 TL | 643,516 | 626,862 | 0.18 |
| USD | 627,374 | VALEANT PHARMA FRN 13/03/22 F1 TB01 | 623,957 | 604,710 | 0.18 |
| USD | 587,872 | ZIGGO BV FRN 15/01/22 TB301 | 576,262 | 572,117 | 0.17 |
| USD | 618,450 | ASURION FRN 29/07/22 INCREM 1ST TB4 | 615,358 | 567,119 | 0.17 |
| USD | 574,010 | NUMERICABLE US LL FRN 21/5/20 TB2 | 573,005 | 555,076 | 0.16 |
| USD | 573,503 | BLACKBOARD FRN 04/10/18 TB3 | 575,276 | 552,177 | 0.16 |
| USD | 554,681 | ZIGGO BV FRN 15/1/22 \$ TB101 | 543,726 | 539,815 | 0.16 |
| USD | 600,000 | NAVISTAR INTL FRN 17/08/17 TB | 591,000 | 531,501 | 0.16 |
| USD | 513,327 | DOLLAR TREE FRN 26/05/22 INIT TB101 | 511,244 | 512,688 | 0.15 |
| USD | 989,744 | NORANDA ALUMINIUM 17/02/19 TB01 | 953,494 | 512,192 | 0.15 |
| USD | 500,000 | LEVEL 3 FIN FRN 1/8/19 TLB3 | 498,125 | 499,873 | 0.15 |
| USD | 496,253 | TRANSFIRST INC FRN 7/11/21 1st TL01 | 491,291 | 493,330 | 0.14 |
| USD | 492,065 | CAPITAL AUTOMOT FRN 19/03/19 TB101 | 491,450 | 492,373 | 0.14 |
| USD | 496,658 | DRUMM INVEST FRN 04/05/18 TL01 | 500,383 | 491,070 | 0.14 |
| USD | 488,617 | ESH HOSPITALITY FRN 06/06/17 TL | 494,114 | 491,060 | 0.14 |
| USD | 495,000 | AMERICAN AIRLINES 15 FRN 12/10/21TB | 491,288 | 490,483 | 0.14 |
| USD | 496,212 | AMERICAN AIRLINE B FRN 27/6/19TL01 | 492,491 | 489,739 | 0.14 |
| USD | 493,655 | SABRE FRN 18/02/19 TB | 490,569 | 489,212 | 0.14 |
| USD | 590,764 | BMC INIT FRN 10/09/20 USD TL01 | 585,739 | 488,645 | 0.14 |
| USD | 500,000 | STERIGENICS NORD FRN 16/5/22 INITTL | 498,750 | 487,500 | 0.14 |
| USD | 500,000 | ALPHA TOPCO/DELTA FRN 30/7/21 TB301 | 496,875 | 485,000 | 0.14 |
| USD | 493,750 | TRANSIDGM INC FRN 21/05/21 TD | 488,813 | 482,376 | 0.14 |
| USD | 492,168 | UNIVISION FRN 01/03/20 INC2013 TL01 | 488,477 | 482,150 | 0.14 |
| USD | 493,734 | TRANS UNION FRN 09/04/21 TB201 | 487,563 | 480,774 | 0.14 |
| USD | 496,250 | BASS PRO GROUP FRN 05/06/20 TL | 495,009 | 479,293 | 0.14 |
| USD | 493,703 | USI COMPASS INVEST FRN 27/12/19 TL | 487,531 | 479,262 | 0.14 |
| USD | 493,750 | DPX HLDS INCREM FRN 11/03/21 USD TL | 488,813 | 477,471 | 0.14 |
| USD | 500,000 | ALPHA TOPC FRN 29/7/22 2ND FAC TL01 | 501,875 | 463,440 | 0.14 |
| USD | 455,332 | BERRY PLASTICS FRN 06/01/21 TE01 | 446,226 | 449,841 | 0.13 |
| USD | 442,628 | CCM MERGER FRN 08/08/21 TLB | 440,414 | 441,021 | 0.13 |
| USD | 492,462 | NEIMAN MARCUS FRN 25/10/20 TL01 | 488,769 | 437,316 | 0.13 |
| USD | 447,750 | PETSMART FRN 11/03/22 TB102 | 445,511 | 437,116 | 0.13 |
| USD | 447,750 | PETSMART FRN 11/03/22 TB103 | 445,511 | 437,116 | 0.13 |
| USD | 447,750 | PETSMART FRN 11/03/22 TB1 | 445,511 | 437,116 | 0.13 |
| USD | 432,446 | KRONOS FRN 30/10/19 1ST LIEN TL01 | 431,906 | 426,230 | 0.13 |

| 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 | 432,436 | LA QUINTA PROP FRN 14/04/21 INITL | 428,653 | 422,346 | 0.12 |
| USD | 428,812 | MPH ACQ FRN 19/03/21 INIT TL | 419,242 | 417,824 | 0.12 |
| USD | 456,750 | IBC CAPITAL FRN 9/9/21 1ST INI TL01 | 456,750 | 416,403 | 0.12 |
| USD | 591,775 | AVAYA FRN 30/04/20 TB701 | 572,047 | 415,556 | 0.12 |
| USD | 443,333 | TTM TECHNOLOGIE FRN 07/05/21 TB | 427,817 | 401,217 | 0.12 |
| USD | 409,688 | INEOS FRN 04/05/18 DOLLAR TL01 | 406,615 | 400,185 | 0.12 |
| USD | 400,000 | MICHAELS STOR FRN 28/1/20 INC TL | 396,500 | 398,166 | 0.12 |
| USD | 403,993 | VIRGIN MEDIA FRN 07/06/23 TLF | 397,007 | 396,238 | 0.12 |
| USD | 397,507 | UNIVISION REPLA FRN 01/3/20 1STL01 | 395,275 | 390,054 | 0.11 |
| USD | 391,872 | BERLIN PACK FRN 01/10/21 1STL | 391,113 | 388,051 | 0.11 |
| USD | 387,522 | RBS GLOBAL FRN 21/08/20 TB01 | 384,373 | 376,625 | 0.11 |
| USD | 367,711 | SPRINGER SCI FRN 01/5/22 INIT TB902 | 365,701 | 353,922 | 0.10 |
| USD | 361,687 | RBS GLOBAL FRN 21/08/20 TB02 | 358,748 | 351,516 | 0.10 |
| USD | 347,335 | LTS BUYER FRN 13/04/20 1ST TLB | 346,467 | 339,260 | 0.10 |
| USD | 333,333 | BURLINGTON COAT FRN 13/08/21 TB302 | 330,833 | 330,278 | 0.10 |
| USD | 328,723 | ZIGGO BV FRN 15/1/22 \$ TB201 | 322,231 | 319,914 | 0.09 |
| USD | 346,482 | LINEAGE LOGIST FRN 07/04/21 TL | 343,018 | 317,031 | 0.09 |
| USD | 299,057 | MINERALS TECHNO FRN 31/05/21 TB2 | 298,309 | 296,066 | 0.09 |
| USD | 284,818 | BE AEROSPACE FRN 19/11/21 TL03 | 283,394 | 285,103 | 0.08 |
| USD | 290,485 | PARTY CITY HLDGS FRN 06/08/22 TL06 | 289,759 | 282,739 | 0.08 |
| USD | 279,348 | BERLIN PACK FRN 1/10/21 1STLIN TL02 | 278,808 | 276,625 | 0.08 |
| USD | 278,844 | UNIVAR USA FRN 01/07/22 INIT \$ TL02 | 277,450 | 270,440 | 0.08 |
| USD | 278,844 | UNIVAR USA FRN 01/7/22 INIT \$ TL01 | 277,450 | 270,440 | 0.08 |
| USD | 363,003 | HERCULES OFF FRN 14/1/19 1ST TL | 352,113 | 265,598 | 0.08 |
| USD | 274,371 | PRISO ACQ FRN 01/05/22 INITIAL TL | 272,999 | 264,768 | 0.08 |
| USD | 263,415 | HILTON WORLWIDE FRN 26/10/20 INTL01 | 262,873 | 263,236 | 0.08 |
| USD | 250,000 | CAPITAL AUTOMOTIVE 30/4/20 2ND TL01 | 250,000 | 250,834 | 0.07 |
| USD | 327,624 | AVAYA FRN 30/03/18 TB601 | 328,443 | 249,268 | 0.07 |
| USD | 248,127 | RIVERBED TECHNO FRN 23/02/22 TL | 246,886 | 247,351 | 0.07 |
| USD | 249,471 | POWER BUYER FRN 06/05/20 1STL01 | 245,106 | 243,338 | 0.07 |
| USD | 250,000 | VALEANT PHAR FRN 13/2/19 1L D2 TB | 247,813 | 241,563 | 0.07 |
| USD | 240,000 | DOLLAR TREE FRN 26/05/22 TB2 | 240,000 | 239,026 | 0.07 |
| USD | 238,197 | RBS GLOBAL FRN 21/08/20 TB04 | 236,261 | 231,499 | 0.07 |
| USD | 225,651 | IMG WORLDWIDE FRN 06/05/21 1ST TL01 | 222,830 | 222,361 | 0.07 |
| USD | 225,000 | HD SUPPLY FRN 08/08/21 TL | 223,875 | 220,313 | 0.06 |
| USD | 218,688 | AMWINS FRN 06/09/19 1ST TL02 | 218,688 | 218,524 | 0.06 |
| USD | 505,389 | MILLENIUM LABO FRN 15/04/21 TB | 505,378 | 216,685 | 0.06 |
| USD | 203,826 | SUPERVALU FRN 21/03/19 TL02 | 202,616 | 201,533 | 0.06 |
| USD | 690,000 | FTS INTL FRN 16/4/21 INIT TL01 | 676,053 | 196,305 | 0.06 |
| USD | 198,977 | CCC INFO SYST FRN 20/12/19 TL | 198,728 | 195,931 | 0.06 |
| USD | 302,857 | GETTY IMAGES FRN 18/10/19 INIT TL01 | 250,212 | 192,314 | 0.06 |
| USD | 246,918 | TERVITA FRN 15/05/18 TL | 233,718 | 191,670 | 0.06 |
| USD | 185,259 | HILTON WORLWIDE FRN 23/9/20 INITL02 | 184,877 | 185,133 | 0.05 |
| USD | 197,985 | SCIENTIFIC GAME FRN 18/10/20 BI TL1 | 194,520 | 181,721 | 0.05 |
| USD | 192,000 | SGMS ESCROW FRN 01/10/21 TB202 | 188,400 | 175,268 | 0.05 |
| USD | 174,563 | JAGUAR HDG CIE II FRN 18/08/22 TL01 | 173,690 | 170,016 | 0.05 |
| USD | 175,927 | SPRINGER SCI FRN 01/5/22 INIT TB901 | 174,958 | 169,330 | 0.05 |
| USD | 162,500 | BE AEROSPACE FRN 19/11/21 TL01 | 161,688 | 162,663 | 0.05 |
| USD | 162,500 | BE AEROSPACE FRN 19/11/21 TL02 | 161,688 | 162,663 | 0.05 |
| USD | 163,764 | ASURION/LONE FRN 24/05/19 1ST TB101 | 162,641 | 153,888 | 0.05 |
| USD | 142,500 | MA FINANCE/MICRO 7/10/19 INITC TL01 | 135,375 | 141,342 | 0.04 |
| USD | 173,682 | CHECKOUT HDGS FRN 09/04/21 1ST TB | 161,415 | 139,814 | 0.04 |
| USD | 149,001 | THE CHEMOURS CO FRN 07/05/22 TLB | 148,256 | 137,204 | 0.04 |
| USD | 122,513 | AMWINS FRN 06/09/19 1ST TL01 | 122,513 | 122,421 | 0.04 |
| USD | 122,575 | PARTY CITY HLDGS FRN 06/08/22 TL03 | 122,268 | 119,306 | 0.04 |
| USD | 100,000 | U AMWINS FRN 06/08/19 DD TL1 | 99,750 | 99,925 | 0.03 |
| USD | 100,000 | FIRST DATA FRN 24/03/21 EXT \$ TL | 99,500 | 99,813 | 0.03 |
| USD | 99,749 | CITGO PETROLEUM FRN 09/0518 TL01 | 100,497 | 99,333 | 0.03 |
| USD | 100,000 | U MPH ACQUISIT FRN 31/03/21 INIT TL | 99,000 | 97,438 | 0.03 |
| USD | 105,000 | SGMS ESCROW FRN 01/10/21 TB201 | 103,031 | 95,850 | 0.03 |

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|--------------------------------------|--------|--------|---------|
| USD | 89,005 | INEOS US FRN 12/03/22 USD TERM | 88,560 | 86,075 | 0.03 |
| USD | 100,000 | W&T OFFSHORE FRN 05/05/20 TL | 99,000 | 85,000 | 0.02 |
| USD | 80,575 | SIG COMBIBLOC FRN 03/02/22 \$ TL02 | 80,172 | 79,489 | 0.02 |
| USD | 75,000 | NEPTUNE FINCO FRN 09/10/22 INITL | 73,875 | 75,040 | 0.02 |
| USD | 75,000 | BERRY PLASTICS FRN 01/10/22 TF01 | 74,625 | 74,465 | 0.02 |
| USD | 72,439 | YORK RISK SVC FRN 1/10/21 INIT TL2 | 71,841 | 68,681 | 0.02 |
| USD | 75,000 | U BMC SOFTWARE FRN 10/9/20 INIT\$TL | 65,063 | 62,036 | 0.02 |
| USD | 64,285 | SPRINGER SCI FRN 01/5/22 INIT TB904 | 63,933 | 61,874 | 0.02 |
| USD | 99,000 | MAGNUM HUNT RES 17/10/19 FRN 2ND TL | 96,030 | 60,143 | 0.02 |
| USD | 55,169 | MGM RESORTS INTL FRN 20/12/19 TB01 | 55,031 | 54,537 | 0.02 |
| USD | 53,730 | AMWINS FRN 06/09/19 1ST TL03 | 53,730 | 53,690 | 0.02 |
| USD | 50,000 | U CSC HDGS LLC FRN 09/10/22 INIT TL | 50,125 | 50,027 | 0.01 |
| USD | 50,000 | U US RENAL CARE FRN 17/11/22 1STTL | 49,500 | 49,688 | 0.01 |
| USD | 51,281 | BWAY HOLD FRN 08/08/20 INIT TL08 | 51,435 | 49,422 | 0.01 |
| USD | 51,281 | BWAY HOLD FRN 08/08/20 INIT TL03 | 51,435 | 49,422 | 0.01 |
| USD | 50,000 | U FIRST DATA CORP FRN 08/07/22 \$ TL | 49,500 | 49,383 | 0.01 |
| USD | 50,000 | CHS/COMM HEALTH FRN 27/1/21 TL.H | 49,313 | 49,322 | 0.01 |
| USD | 48,750 | BURLINGTON COAT FRN 13/08/21 TB301 | 48,384 | 48,303 | 0.01 |
| USD | 50,000 | U VALEANT FRN 01/04/22 SERIE F1 TB | 47,938 | 48,194 | 0.01 |
| USD | 47,474 | HARLAN CLARKE FRN 30/06/17 B2 TL01 | 47,621 | 46,050 | 0.01 |
| USD | 50,000 | U NEIMAN MARCUS FRN 25/10/20 TL | 46,438 | 44,401 | 0.01 |
| USD | 49,875 | 21ST CENT ONC FRN 14/04/22 TB | 49,376 | 42,144 | 0.01 |
| USD | 41,667 | BURLINGTON COAT FRN 13/08/21 TB305 | 41,354 | 41,285 | 0.01 |
| USD | 41,667 | BURLINGTON COAT FRN 13/08/21 TB303 | 41,354 | 41,285 | 0.01 |
| USD | 40,525 | HILTON WORLWIDE FRN 26/10/20 INTL06 | 40,442 | 40,498 | 0.01 |
| USD | 125,000 | TEXAS COMP EXT FRN 10/10/17 TL01 | 76,563 | 39,188 | 0.01 |
| USD | 38,736 | SAGE PROD FRN 13/12/19 INIT 1STL01 | 38,542 | 38,373 | 0.01 |
| USD | 35,777 | LANDMARK AV FRN 25/10/19 CAD 1STL01 | 35,659 | 35,676 | 0.01 |
| USD | 33,813 | POWER BUYER FRN 06/05/20 1STL02 | 33,222 | 32,982 | 0.01 |
| USD | 32,443 | SPRINGER SCI FRN 01/5/22 INIT TB907 | 32,265 | 31,226 | 0.01 |
| USD | 28,723 | ZIGGO BV FRN 15/01/22 TB2 02 TL | 28,156 | 27,954 | 0.01 |
| USD | 25,000 | U RHP HOTEL PROP FRN 05/1/21 1STL-B | 25,063 | 24,973 | 0.01 |
| USD | 25,000 | NXP BV FRN 30/10/22 TB01 | 24,813 | 24,909 | 0.01 |
| USD | 25,000 | ANCESTRY COMM FRN 17/08/22 INIT TL | 24,750 | 24,859 | 0.01 |
| USD | 24,811 | SEDGWICK FRN 01/03/21 1STL TL01 | 24,067 | 23,865 | 0.01 |
| USD | 25,000 | ASURION FRN 03/03/21 2ND TL01 | 24,875 | 21,513 | 0.01 |
| USD | 21,296 | ADVANTAGE SAL FRN 23/07/21 1ST TL02 | 20,978 | 20,531 | 0.01 |
| USD | 20,599 | IMG WORLDWIDE FRN 06/05/21 1ST TL02 | 20,342 | 20,299 | 0.01 |
| USD | 20,899 | SPRINGER SCI FRN 01/5/22 INIT TB903 | 20,784 | 20,115 | 0.01 |
| USD | 19,831 | MGM RESORTS INTL FRN 20/12/19 TB02 | 19,781 | 19,604 | 0.01 |
| USD | 19,778 | DTZ FRN 04/11/21 INIT 1ST TL07 | 19,679 | 19,325 | 0.01 |
| USD | 16,219 | SPRINGER SCI FRN 01/5/22 INIT TB905 | 16,130 | 15,611 | 0.00 |
| USD | 50,000 | AMERICAN NRG FRN 4/8/20 INIT 1STL | 43,500 | 13,583 | 0.00 |
| USD | 13,831 | POWER BUYER FRN 06/05/20 1STL03 | 13,589 | 13,491 | 0.00 |
| USD | 13,433 | PARTY CITY HLDGS FRN 06/08/22 TL04 | 13,399 | 13,075 | 0.00 |
| USD | 12,919 | MAGNUM HUNTER FRN 02/02/16 TL | 12,919 | 12,919 | 0.00 |
| USD | 11,754 | PARTY CITY HLDGS FRN 06/08/22 TL05 | 11,724 | 11,440 | 0.00 |
| USD | 9,209 | DTZ FRN 04/11/21 INIT 1ST TL01 | 9,163 | 8,998 | 0.00 |
| USD | 7,986 | ADVANTAGE SAL FRN 23/07/21 1ST TL03 | 7,946 | 7,699 | 0.00 |
| USD | 6,716 | PARTY CITY HLDGS FRN 06/08/22 TL01 | 6,700 | 6,537 | 0.00 |
| USD | 6,304 | MAGNUM HUNT RES FRN 17/9/16 DIPTL | 6,304 | 6,320 | 0.00 |
| USD | 5,515 | MICHAELS STOR FRN 28/1/20 INC TL02 | 5,466 | 5,489 | 0.00 |
| USD | 5,037 | PARTY CITY HLDGS FRN 06/08/22 TL02 | 5,025 | 4,903 | 0.00 |
| USD | 3,744 | ALTICE FIN \$ DEN FRN 30/1/22 TL07 | 3,706 | 3,736 | 0.00 |
| USD | 4,310 | CERIDIAN CO FRN 15/9/20 REPS1STTL02 | 4,296 | 3,685 | 0.00 |
| USD | 3,301 | ADVANTAGES SALE FRN 23/7/21 TL05 | 3,284 | 3,182 | 0.00 |
| USD | 3,128 | BWAY HOLD FRN 08/08/20 INIT TL09 | 3,138 | 3,015 | 0.00 |
| USD | 2,516 | BRICKMAN FRN 18/12/20 1ST TL06 | 2,472 | 2,445 | 0.00 |
| USD | 2,307 | LANDMARK AV FRN 25/10/19 US 1STL06 | 2,299 | 2,300 | 0.00 |
| USD | 2,390 | HUB INTL LTD FRN 02/10/20 INIT TL07 | 2,371 | 2,261 | 0.00 |

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|-------------|-------------|---------|
| USD | 1,989 | DTZ FRN 04/11/21 INIT 1ST TL11 | 1,979 | 1,943 | 0.00 |
| USD | 1,982 | DTZ FRN 04/11/21 INIT 1ST TL10 | 1,973 | 1,937 | 0.00 |
| USD | 1,675 | NUMERICABLE US FRN 21/5/20 B1 TL05 | 1,673 | 1,620 | 0.00 |
| USD | 1,625 | LIFE TIME FITNESS FRN 10/06/22 TL02 | 1,617 | 1,575 | 0.00 |
| USD | 1,450 | NUMERICABLE US FRN 21/5/20 B2 TL05 | 1,447 | 1,402 | 0.00 |
| USD | 1,250 | BASS PRO GROUP FRN 05/06/20 TL03 | 1,247 | 1,207 | 0.00 |
| USD | 1,256 | NEIMAN MARCUS FRN 25/10/20 TL10 | 1,247 | 1,116 | 0.00 |
| USD | 1,074 | KRONOS FRN 30/10/19 1ST LIEN TL09 | 1,073 | 1,059 | 0.00 |
| USD | 750 | SGMS ESCROW FRN 01/10/21 TB203 | 736 | 685 | 0.00 |
| USD | 631 | DTZ FRN 04/11/21 INIT 1ST TL02 | 628 | 617 | 0.00 |
| USD | 573 | IMG WORLDWIDE FRN 06/05/21 1ST TL12 | 566 | 564 | 0.00 |
| USD | 374 | THE CHEMOURS CO FRN 07/05/22 TB02 | 372 | 345 | 0.00 |
| USD | 92 | LANDMARK AV FRN 25/10/19 CADISTTL06 | 92 | 92 | 0.00 |
| USD | 71 | DTZ FRN 04/11/21 INIT 1ST TL09 | 71 | 69 | 0.00 |
| USD | 52 | IMG WORLDWIDE FRN 06/05/21 1ST TL11 | 52 | 52 | 0.00 |
| USD | 32 | DTZ FRN 04/11/21 INIT 1ST TL14 | 32 | 32 | 0.00 |
| USD | 28 | DTZ FRN 04/11/21 INIT 1ST TL13 | 28 | 28 | 0.00 |
| USD | 26 | DTZ FRN 04/11/21 INIT 1ST TL12 | 26 | 26 | 0.00 |
| USD | 20 | DTZ FRN 04/11/21 INIT 1ST TL08 | 20 | 20 | 0.00 |
| | | | 105,657,557 | 100,669,855 | 29.58 |

モーゲージ担保証券

| | | | | | |
|-----|-----------|------------------------------------|-----------|-----------|------|
| USD | 933,000 | AIREM 07-1A 2A1 FRN 20/09/66 | 624,822 | 610,671 | 0.18 |
| USD | 500,000 | OCF 2015-9A A1 CLO FRN 15/07/27 | 500,000 | 493,119 | 0.14 |
| USD | 400,000 | MABS 05-HE2 M2 FRN 25/10/35 | 351,000 | 356,502 | 0.10 |
| USD | 250,000 | RAAC 2006 SP3 M1 FRN 25/08/36 | 222,250 | 220,541 | 0.06 |
| USD | 600,000 | DBALT 07-OA3 A1 FRN 25/07/47 | 220,507 | 207,187 | 0.06 |
| USD | 650,000 | LXS 06-16N A4A FRN 25/11/46 | 183,345 | 177,711 | 0.05 |
| USD | 1,000,000 | CWALT 05-IM1 A1 FRN 25/01/36 | 175,944 | 177,079 | 0.05 |
| USD | 2,000,000 | FNR 13-121 SA IO FRN 25/12/43 | 184,095 | 171,796 | 0.05 |
| USD | 1,059,596 | GNR 15-110 IO FRN 20/08/45 | 158,295 | 148,627 | 0.04 |
| USD | 600,000 | RALI 2007-QH9 A1 FRN 25/11/37 | 152,238 | 147,533 | 0.04 |
| USD | 400,000 | BSMF 07-AR5 2A1 FRN 25/06/37 | 145,931 | 147,349 | 0.04 |
| USD | 400,000 | AHMA 06-2 1A1 FRN 25/09/46 | 121,243 | 119,847 | 0.04 |
| USD | 185,000 | JPALT 07-A2 12A3 FRN 25/06/37 | 103,559 | 103,148 | 0.03 |
| USD | 570,000 | LXS 05-7N 1A1A FRN 25/12/35 | 104,028 | 101,631 | 0.03 |
| USD | 2,100,000 | GNR 10-20 SE IO FRN 20/02/40 | 96,061 | 98,141 | 0.03 |
| USD | 750,000 | FNR 15-81 SA IO FRN 25/11/45 | 95,621 | 94,759 | 0.03 |
| USD | 1,000,000 | GNR 13-181 SA IO FRN 20/11/43 | 94,342 | 93,138 | 0.03 |
| USD | 100,000 | LSTRZ 2015-3 A FRN 01/03/20 | 91,487 | 91,370 | 0.03 |
| USD | 300,000 | SAMI 05-AR7 5A1 FRN 25/03/46 | 91,926 | 89,725 | 0.03 |
| USD | 500,000 | G2SF 4 2015-159 HS IO FRN 20/11/45 | 87,445 | 87,634 | 0.03 |
| USD | 200,000 | IMSA 07-1 A2 FRN 25/03/37 | 89,157 | 87,323 | 0.03 |
| USD | 105,000 | GCCFC 07-GG11 A4 5.736% 10/12/49 | 92,774 | 87,160 | 0.03 |
| USD | 400,000 | LUM 06-7 1A1 FRN 25/12/36 | 76,389 | 78,470 | 0.02 |
| USD | 90,000 | MLMI 05-A8 A3A3 FRN 25/08/36 | 77,850 | 77,754 | 0.02 |
| USD | 500,000 | FNR 15-82 MS IO FRN 25/11/45 | 73,351 | 68,765 | 0.02 |
| USD | 525,000 | FNR 14-87 IO FRN 25/01/45 | 69,011 | 63,873 | 0.02 |
| USD | 800,000 | IMJA 07-A1 A3 6% 25/08/37 | 65,699 | 61,841 | 0.02 |
| USD | 200,000 | LXS 06-14N 1A1A FRN 25/09/46 | 53,207 | 54,329 | 0.02 |
| USD | 200,000 | CWALT 06-OA14 2A1 FRN 25/11/46 | 46,968 | 47,334 | 0.01 |
| USD | 500,000 | G2SF 5 2012-149 MS IO FRN 20/12/42 | 36,852 | 35,030 | 0.01 |
| USD | 775,000 | GNR 10-31 SA IO FRN 20/03/40 | 35,415 | 34,896 | 0.01 |
| USD | 250,000 | GNR 14-41 SA IO FRN 20/03/44 | 26,153 | 24,872 | 0.01 |
| USD | 250,000 | FHR 4320 SD IO FRN 15/07/39 | 25,037 | 24,441 | 0.01 |
| USD | 250,000 | GNR 2013-134 DS IO FRN 20/09/43 | 23,227 | 23,577 | 0.01 |
| USD | 20,000 | CAS 15-C01 2M1 FRN 25/02/25 | 4,802 | 4,805 | 0.00 |
| | | | 4,600,031 | 4,511,978 | 1.33 |

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| 商業不動産担保証券 | | | | | |
| USD | 1,100,000 | FHMS K044 A2 2.811% 25/01/25 | 1,132,976 | 1,079,385 | 0.32 |
| USD | 325,000 | CSMC 07-C1 A3 5.383% 15/02/40 | 272,163 | 257,719 | 0.08 |
| USD | 230,000 | JPMCC 06-CB17 A4 5.429% 12/12/43 | 229,834 | 222,876 | 0.07 |
| USD | 226,000 | GSMS 07-GG10 A4 FRN 10/08/45 | 222,377 | 208,449 | 0.06 |
| USD | 225,000 | CSMC 06-C4 A3 5.467% 15/09/39 | 189,712 | 179,319 | 0.05 |
| USD | 2,400,000 | WFRBS 14-C21 XA IO 1.36% 15/08/47 | 194,949 | 162,568 | 0.05 |
| USD | 175,000 | GCCFC 07 GG9 A4 5.444% 10/03/39 | 160,298 | 151,001 | 0.04 |
| USD | 1,750,000 | UBSBB 12-C4 XA IO FRN 10/12/45 | 177,272 | 144,166 | 0.04 |
| USD | 1,925,000 | COMM 14 LC15 XA IO FRN 10/04/47 | 149,866 | 132,709 | 0.04 |
| USD | 120,000 | CSMC 07-C5 A4 5.695% 15/09/40 | 124,076 | 119,131 | 0.04 |
| USD | 2,150,000 | CGCMT 13-GC15 XA IO FRN 10/09/46 | 145,349 | 114,061 | 0.03 |
| USD | 100,000 | WBCMT 07-C32 FRN 15/06/49 | 109,301 | 102,439 | 0.03 |
| USD | 115,000 | CWCI 07-C3 A4 FRN 15/05/46 | 107,775 | 102,011 | 0.03 |
| USD | 1,000,000 | CGCMT 15-GC27 XA IO FRN 10/02/48 | 106,663 | 93,738 | 0.03 |
| USD | 125,000 | CSMC 07-C4 A4 FRN 15/09/39 | 93,462 | 89,561 | 0.03 |
| USD | 1,500,000 | WFRBS 14-C22 XA IO 0.971% 15/09/57 | 97,277 | 82,542 | 0.02 |
| USD | 100,000 | CMLT 08 LS1 A4B FRN 10/09/17 | 84,581 | 79,999 | 0.02 |
| USD | 1,100,000 | WFRBS 14-LC14 XA IO FRN 15/03/47 | 94,844 | 77,488 | 0.02 |
| USD | 1,300,000 | GSMS 15-GC30 XA IO FRN 10/05/50 | 80,091 | 72,751 | 0.02 |
| USD | 1,115,000 | CGCMT 13-GC17 XA IO FRN 10/11/46 | 87,912 | 68,849 | 0.02 |
| | | | 3,860,778 | 3,540,762 | 1.04 |
| 変動金利債 | | | | | |
| USD | 825,000 | CITIGROUP INC FRN 29/12/49 HYBRID | 822,312 | 807,262 | 0.23 |
| USD | 755,000 | GOLDMAN SACHS FRN 29/12/49 L | 769,508 | 754,169 | 0.22 |
| USD | 865,000 | GOLDMAN SACHS CAP II FRN 01/12/49 | 665,787 | 601,174 | 0.18 |
| USD | 698,000 | LINCOLN NATL CORP FRN 17/05/66 | 708,425 | 530,479 | 0.16 |
| USD | 485,000 | CITIGROUP INC FRN 29/12/49 M | 481,076 | 470,378 | 0.14 |
| USD | 457,000 | MORGAN STANLEY FRN 29/12/49 | 457,000 | 455,198 | 0.13 |
| USD | 531,000 | GLEN MEADOW FRN 12/02/67 144A | 489,485 | 423,473 | 0.12 |
| USD | 409,000 | JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/04/49 1 | 449,389 | 415,266 | 0.12 |
| USD | 350,000 | GE CAP TRUST I FRN 15/11/67 | 378,350 | 363,781 | 0.11 |
| USD | 350,000 | BANK OF AMERICA CORP FRN 29/07/49 K | 385,187 | 356,125 | 0.10 |
| USD | 250,000 | JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/01/49 | 264,375 | 271,265 | 0.08 |
| USD | 240,000 | ING US INC FRN 15/05/53 | 245,506 | 236,400 | 0.07 |
| USD | 235,000 | CAPITAL ONE FINCL CO FRN 29/12/49 E | 235,000 | 233,242 | 0.07 |
| USD | 220,000 | METLIFE INC FRN 29/12/49 C | 220,000 | 223,850 | 0.07 |
| USD | 205,000 | MORGAN STANLEY FRN 29/07/49 H | 205,513 | 200,187 | 0.06 |
| USD | 190,000 | PRUDENTIAL FIN FRN 15/05/45 | 190,000 | 189,763 | 0.06 |
| USD | 185,000 | CITIGROUP INC FRN 29/11/49 N | 185,000 | 183,428 | 0.05 |
| USD | 175,000 | PRUDENTIAL FIN FRN 5.2% 15/03/44 | 176,493 | 168,963 | 0.05 |
| USD | 185,000 | ILFC E CAP TRUST I FRN 21/12/65 144 | 177,600 | 168,350 | 0.05 |
| USD | 168,000 | GENERAL ELEC CO FRN 29/12/49 C | 157,078 | 167,160 | 0.05 |
| USD | 150,000 | BANK OF AMERICA CORP FRN 23/10/49 Z | 150,875 | 158,489 | 0.05 |
| USD | 150,000 | BANK OF AMERICA CORP FRN 29/12/49 | 148,677 | 142,896 | 0.04 |
| USD | 140,000 | JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/12/49 R | 142,968 | 140,580 | 0.04 |
| USD | 130,000 | BANK OF AMERICA FRN 29/12/49 AA | 130,000 | 131,788 | 0.04 |
| USD | 141,000 | ILFC E-CAP TR II FRN 21/12/65 144A | 137,475 | 129,720 | 0.04 |
| USD | 135,000 | AMERICAN EXPRESS FRN 29/12/49 | 135,000 | 128,250 | 0.04 |
| USD | 100,000 | BANK OF AMERICA CORP FRN 29/09/49 X | 99,938 | 101,084 | 0.03 |
| USD | 75,000 | JP MORGAN CHASE & CO FRN 29/12/49 U | 75,188 | 75,813 | 0.02 |
| USD | 75,000 | TENET HEALTHCARE FRN 15/06/20 144A | 74,625 | 73,500 | 0.02 |
| USD | 75,000 | ENTREPRISE PRODUCTS FRN 01/08/66 A | 76,688 | 67,500 | 0.02 |
| USD | 50,000 | CITIGROUP INC FRN 29/12/49 Q | 50,000 | 49,862 | 0.01 |
| USD | 50,000 | GOLDMAN SACHS FRN 31/12/49 M | 50,219 | 49,250 | 0.01 |
| USD | 25,000 | WELLS FARGO & CO FRN 31/12/49 U | 25,000 | 26,255 | 0.01 |
| USD | 25,000 | AMERICAN EXPRESS FRN 01/09/66 | 25,313 | 25,188 | 0.01 |
| USD | 25,000 | JPMORGAN CHASE & CO FRN 29/12/49 Z | 25,000 | 24,929 | 0.01 |
| USD | 25,000 | CITIGROUP INC FRN 29/12/49 | 25,175 | 24,834 | 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 | JPMORGAN CHASE CO FRN 29/12/49 V | 24,625 | 23,792 | 0.01 |
| | | | 9,059,850 | 8,593,643 | 2.53 |
| 投資信託 | | | | | |
| -- | 21,170 | ISHARES JP MORGAN USD EMERGING ETF | 2,410,963 | 2,240,633 | 0.66 |
| -- | 26,200 | ISHARES IBOXX USD H/Y CORP BOND ETF | 2,444,638 | 2,102,026 | 0.62 |
| -- | 45,570 | SPDR BARCLAYS CAPITAL HIGH ETF | 1,864,936 | 1,540,494 | 0.45 |
| -- | 11,694 | POWERSHARES SENIOR LOAN ETF | 286,313 | 261,653 | 0.08 |
| | | | 7,006,850 | 6,144,806 | 1.81 |
| 普通株式 | | | | | |
| -- | 49,600 | SPDR BARCLAYS SHORT-TERM HIGH | 1,442,403 | 1,272,488 | 0.38 |
| -- | 4,875 | UCI HOLDINGS INC COMMON STOCK | 77,406 | 129,188 | 0.04 |
| -- | 7,444 | NII HOLDINGS INC | 151,474 | 37,071 | 0.01 |
| -- | 5,195 | HERCULES OFFSHORE INC | 299,563 | 11,481 | 0.00 |
| -- | 2,747 | HALCON RESOURCES CORP | 18,563 | 3,516 | 0.00 |
| | | | 1,989,409 | 1,453,744 | 0.43 |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 400,000 | HOMER CITY GEN PIK 8.637% 01/10/19 | 337,896 | 269,019 | 0.08 |
| USD | 435,000 | ELWOOD ENERGY 8.159% 05/07/26 | 194,225 | 188,603 | 0.06 |
| USD | 200,000 | AMER AIRL 13-2 B PT 5.6% 15/7/20 14 | 179,009 | 177,699 | 0.05 |
| USD | 170,000 | AMER AIRLINES 14-1 B 4.375% 1/10/22 | 157,965 | 153,717 | 0.05 |
| USD | 510,050 | IHEART COMM INC PIK 14% 01/02/21 | 505,000 | 142,814 | 0.04 |
| USD | 185,000 | HOMER CITY GEN PIK 8.734% 01/10/26 | 177,773 | 138,750 | 0.04 |
| USD | 100,000 | RED OAK POWER 9.2% 30/11/29 B | 108,250 | 106,500 | 0.03 |
| USD | 100,000 | ENERGY FUT HDG 11.75% 01/03/22 144A | 91,244 | 84,500 | 0.02 |
| | | | 1,751,362 | 1,261,602 | 0.37 |
| ペイ・イン・カインド(PIK)債 | | | | | |
| USD | 200,000 | CARLSON TRAVEL PIK 8.25% 15/8/19 14 | 200,999 | 197,000 | 0.06 |
| USD | 158,000 | FIRST DATA PIK 8.75% 15/01/22 144A | 171,233 | 165,086 | 0.05 |
| USD | 100,000 | BUMBLE BEE 9.625% PIK 15/03/18 144A | 103,500 | 99,750 | 0.03 |
| USD | 100,000 | ANCESTRY PIK 10.375% 15/10/18 144A | 102,500 | 98,500 | 0.03 |
| USD | 100,000 | INFOR SOFT PIK 7.125% 01/05/21 144A | 100,438 | 72,250 | 0.02 |
| | | | 678,670 | 632,586 | 0.19 |
| ステップアップ/ダウン債 | | | | | |
| USD | 300,000 | SABINE PASS LIQ 5.625% 15/04/23 | 284,209 | 262,500 | 0.08 |
| USD | 200,000 | REYNOLDS GRP ISS STUP 8.5% 15/05/18 | 204,800 | 197,750 | 0.06 |
| USD | 144,000 | SABINE PASS LIQ 5.625% 01/02/21 | 142,020 | 131,400 | 0.04 |
| USD | 100,000 | RITE AID CORP 6.875% 15/12/28 | 109,250 | 112,000 | 0.03 |
| USD | 50,000 | JACK COOPER HLDG 9.25% 1/06/20 144A | 47,250 | 41,500 | 0.01 |
| USD | 200,000 | LINN NRG LLC/FIN STUP 01/11/19 | 134,531 | 33,000 | 0.01 |
| | | | 922,060 | 778,150 | 0.23 |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 1,250,000 | KINETICS/ KCI USA 10.5% 01/11/18 | 1,378,124 | 1,215,624 | 0.35 |
| USD | 1,124,000 | REYNOLDS GRP ISS 9.875% 15/08/19 WI | 1,220,296 | 1,132,429 | 0.32 |
| USD | 939,000 | CHS COMMUNITY 8% 15/11/19 | 1,015,382 | 943,694 | 0.28 |
| USD | 973,000 | NRG ENERGY INC 7.875% 15/05/21 | 1,059,521 | 912,089 | 0.27 |
| USD | 600,000 | DAIMLERCHRYSLER NA 8.5% 18/01/31 | 914,421 | 867,991 | 0.26 |
| USD | 1,200,000 | SPRINT CORP 7.125% 15/06/24 WI | 1,223,767 | 865,499 | 0.25 |
| USD | 1,142,000 | SPRINT CORP 7.875% 15/09/23 | 1,218,893 | 856,499 | 0.25 |
| USD | 750,000 | CINCINNATI BELL 8.375% 15/10/20 | 813,749 | 764,999 | 0.22 |
| USD | 687,000 | BOYD GAMING CORP 6.875% 15/05/23 | 691,566 | 707,609 | 0.21 |
| USD | 612,000 | HCA INC 7.5% 15/02/22 | 709,276 | 673,199 | 0.20 |
| USD | 628,000 | POST HLDGS 7.375% 15/02/22 | 659,469 | 654,689 | 0.19 |
| USD | 650,000 | AUDATEX NORTH AMER 6.125% 1/11/23 1 | 671,749 | 654,062 | 0.19 |
| USD | 850,000 | CENTURLINK INC 7.65% 15/03/42 | 849,264 | 647,593 | 0.19 |

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|---------|---------|
| USD | 599,000 | UNITED RENTALS 7.625% 15/04/22 | 667,232 | 636,437 | 0.19 |
| USD | 600,000 | VERIZON COMM 4.15% 15/03/24 | 622,757 | 615,437 | 0.18 |
| USD | 700,000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV 3.75% 15/07/42 | 668,037 | 598,944 | 0.18 |
| USD | 600,000 | ENDO FIN LLC/FINCO 6% 01/02/25 144A | 604,312 | 593,999 | 0.17 |
| USD | 600,000 | APPLE INC 2.4% 03/05/23 | 575,674 | 583,945 | 0.17 |
| EUR | 500,000 | GOLDMAM SACHS GP 2.5% 18/10/21 EMTN | 676,051 | 580,726 | 0.17 |
| USD | 490,000 | AMGEN INC 6.4% 01/02/39 | 609,113 | 578,874 | 0.17 |
| USD | 642,000 | DISH DBS CORP 5.875% 15/11/24 | 640,381 | 573,787 | 0.17 |
| USD | 551,000 | CCO HDGS LLC/CAP 6.5% 30/04/21 | 579,600 | 573,039 | 0.17 |
| USD | 600,000 | SONIC AUTO INC 5% 15/05/23 | 584,812 | 569,999 | 0.17 |
| USD | 550,000 | ALLY FINANCIAL INC 5.125% 30/09/24 | 540,770 | 563,062 | 0.17 |
| USD | 575,000 | KENNEDY WILSON 5.875% 01/04/24 | 574,999 | 557,749 | 0.16 |
| USD | 750,000 | AVAYA INC 7% 01/04/19 144A | 745,374 | 554,999 | 0.16 |
| USD | 770,000 | SCIENTIFIC GAMES INTL 10% 01/12/22 | 724,629 | 546,699 | 0.16 |
| USD | 586,000 | BEAZER HOMES USA 5.75% 15/06/19 | 571,972 | 539,119 | 0.16 |
| USD | 525,000 | T-MOBILE USA INC 6% 01/03/23 | 526,955 | 531,562 | 0.16 |
| USD | 501,000 | DENALI BORROWER 5.625% 15/10/20 144 | 521,406 | 524,797 | 0.15 |
| USD | 525,000 | GROUP 1 AUTO 5% 01/06/22 | 519,624 | 519,749 | 0.15 |
| USD | 496,000 | UNITED CONTINENTAL 6.375% 01/06/18 | 525,838 | 516,147 | 0.15 |
| USD | 500,000 | CCO HDGS LLC/CAP 5.75% 01/09/23 | 502,499 | 512,499 | 0.15 |
| USD | 500,000 | METLIFE INC 3.6% 10/04/24 | 507,166 | 511,979 | 0.15 |
| USD | 500,000 | MORGAN STANLEY 3.75% 25/02/23 | 505,516 | 511,242 | 0.15 |
| USD | 500,000 | T-MOBILE USA INC 5.25% 01/09/18 | 516,874 | 509,999 | 0.15 |
| USD | 524,000 | GRIFFON CORP 5.25% 01/03/22 | 509,554 | 499,764 | 0.15 |
| USD | 501,000 | FRONTIER COMM 10.5% 15/09/22 144A | 489,882 | 499,747 | 0.15 |
| USD | 500,000 | ALLY FINANCIAL INC 3.5% 27/01/19 | 504,999 | 493,124 | 0.14 |
| USD | 482,000 | US AIRWAYS GROUP 6.125% 01/06/18 | 499,599 | 492,603 | 0.14 |
| USD | 480,000 | MGM RESORTS INTL 6.625% 15/12/21 | 520,967 | 491,399 | 0.14 |
| USD | 512,000 | VIKING CRUISES 8.5% 15/10/22 144A | 563,670 | 487,679 | 0.14 |
| USD | 475,000 | LEVEL 3 FIN INC 5.375% 15/08/22 WI | 472,030 | 482,124 | 0.14 |
| USD | 510,000 | SPRINGLEAF FIN CORP 5.25% 15/12/19 | 509,999 | 481,949 | 0.14 |
| USD | 502,000 | CLEAR CHAN WLD 6.5% 15/11/22 WI | 528,674 | 481,919 | 0.14 |
| EUR | 400,000 | JPMORGAN CHASE CO 2.875% 24/5/28 EM | 529,250 | 481,912 | 0.14 |
| USD | 467,000 | SPRINGLEAF FIN CORP 6.9% 15/12/17 M | 504,363 | 481,010 | 0.14 |
| USD | 520,000 | CLEAR CHAN WLD 7.625% 15/3/20 WI-B | 547,579 | 481,000 | 0.14 |
| USD | 475,000 | T-MOBILE USA INC 6.5% 15/01/24 | 484,956 | 480,938 | 0.14 |
| USD | 500,000 | ANHEUSER-BUSH INBEV 2.5% 15/07/22 | 480,999 | 480,206 | 0.14 |
| USD | 550,000 | WEST CORP 5.375% 15/07/22 144A | 528,124 | 478,500 | 0.14 |
| USD | 690,000 | ASSOC MATERIAL 9.125% 01/11/17 | 643,424 | 476,100 | 0.14 |
| USD | 472,000 | BUILDERS FIRSTS 10.75% 15/8/23 144A | 474,703 | 474,360 | 0.14 |
| USD | 476,000 | CCO SAFARI II 4.908% 23/07/25 144A | 476,244 | 474,180 | 0.14 |
| USD | 440,000 | LEVI STRAUSS&CO 6.875% 01/05/22 | 479,111 | 472,450 | 0.14 |
| USD | 500,000 | REGENCY ENERGY 5.875% 01/03/22 | 537,500 | 470,403 | 0.14 |
| USD | 492,000 | CHS/COMM HEALTH 6.875% 01/02/22 WI | 516,830 | 466,170 | 0.14 |
| USD | 480,000 | SUNOCO LP/FIN 5.5% 01/08/20 144A | 480,000 | 454,800 | 0.13 |
| USD | 500,000 | MICRON TECHNO 5.25% 01/08/23 144A | 500,000 | 448,750 | 0.13 |
| USD | 425,000 | T-MOBILE USA INC 6.731% 28/04/22 | 442,800 | 443,063 | 0.13 |
| USD | 450,000 | MGM RESORTS INTL 6% 15/03/23 | 453,850 | 442,436 | 0.13 |
| USD | 417,000 | RITE AID CORP 6.75% 15/06/21 WI | 434,105 | 435,765 | 0.13 |
| USD | 575,000 | SPRINT CAPITAL 8.75% 15/03/32 | 590,993 | 432,688 | 0.13 |
| USD | 441,000 | REVLON CONSUMER 5.75% 15/02/21 | 443,766 | 425,565 | 0.13 |
| USD | 400,000 | HRG GROUP 7.875% 15/07/19 | 425,000 | 421,000 | 0.12 |
| USD | 400,000 | SPRINT NEXTEL 9% 15/11/18 144A | 471,525 | 419,000 | 0.12 |
| USD | 400,000 | NEPTUNE FINCO 10.125% 15/01/23 144A | 414,750 | 417,000 | 0.12 |
| USD | 400,000 | PRESTIGE BRANDS INC FRN 01/02/20 | 432,500 | 414,000 | 0.12 |
| USD | 400,000 | MORGAN STANLEY 4% 23/07/25 GMTN | 413,758 | 411,456 | 0.12 |
| USD | 414,000 | AMERICAN AIRLINES 5.5% 1/10/19 144A | 414,813 | 408,825 | 0.12 |
| USD | 421,000 | KB HOME 4.75% 15/05/19 | 416,790 | 408,370 | 0.12 |
| USD | 418,000 | COTT BEVERAGES 5.375% 01/07/22 | 399,903 | 406,505 | 0.12 |
| USD | 400,000 | LYNX II CORP 6.375% 15/04/23 144A | 425,500 | 406,000 | 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 | 575,000 | ORTHO-CLINICAL 6.625% 15/05/22 144A | 543,188 | 396,750 | 0.12 |
| USD | 415,000 | SUNOCO LP/FIN 6.375% 01/04/23 144A | 415,000 | 389,063 | 0.11 |
| USD | 400,000 | CITGO HOLDING 10.75% 15/02/20 144A | 386,074 | 388,000 | 0.11 |
| USD | 366,000 | IRON MOUNTAIN INC 6% 01/10/20 144A | 366,000 | 385,215 | 0.11 |
| USD | 400,000 | VOLKSWAGEN GRP 2.45% 20/11/19 REGS | 399,104 | 382,910 | 0.11 |
| USD | 575,000 | BMC SOFTWARE 8.125% 15/07/21 144A | 571,869 | 382,375 | 0.11 |
| USD | 405,000 | TENET HEALTHCARE 5.5% 01/03/19 | 407,119 | 381,713 | 0.11 |
| USD | 490,000 | HEXION US FIN 6.625% 15/04/20 WI | 489,112 | 380,975 | 0.11 |
| USD | 440,000 | K HOVNIANIAN ENT 7.25% 15/10/20 144A | 465,950 | 378,400 | 0.11 |
| USD | 500,000 | SUMMIT MID HDGS 5.5% 15/08/22 | 505,000 | 365,000 | 0.11 |
| USD | 350,000 | TENET HEALTHCARE 6% 01/10/20 | 380,065 | 364,875 | 0.11 |
| USD | 369,000 | CEQUEL COM HLD 6.375% 15/09/20 144A | 386,940 | 360,698 | 0.11 |
| USD | 350,000 | UNIVISION COMM 5.5% 15/05/21 144A | 377,578 | 357,875 | 0.11 |
| USD | 340,000 | LIFEPOINT HOSPI 5.5% 01/12/21 | 353,600 | 345,100 | 0.10 |
| USD | 350,000 | MICRON TECH INC 5.875% 15/02/22 | 362,250 | 340,375 | 0.10 |
| USD | 325,000 | CIT GROUP INC 5.5% 15/02/19 144A | 346,796 | 339,625 | 0.10 |
| USD | 324,000 | FREESCALE SEMIC 6% 15/01/22 144A | 340,288 | 339,390 | 0.10 |
| USD | 325,000 | HD SUPPLY INC 7.5% 15/07/20 | 347,344 | 338,000 | 0.10 |
| USD | 550,000 | CLAIRE'S ST 9% 15/03/19 144a | 562,063 | 363,875 | 0.10 |
| USD | 398,000 | INFOR US INC 6.5% 15/05/22 144A | 401,449 | 336,310 | 0.10 |
| USD | 375,000 | MIDAS INT HOLD 7.875% 01/10/22 144A | 370,563 | 335,625 | 0.10 |
| USD | 414,000 | NAVIENT CORP 5.875% 25/10/24 | 406,381 | 331,200 | 0.10 |
| USD | 350,000 | ZAYO GROUP LLC/CAP 6% 01/04/23 | 351,438 | 329,000 | 0.10 |
| USD | 316,000 | EQUINIX INC 5.875% 15/01/26 | 316,589 | 325,480 | 0.10 |
| USD | 500,000 | ADVANCED MICRO 7% 01/07/24 | 511,250 | 325,000 | 0.10 |
| USD | 414,000 | WINDSTREAM CORP 7.75% 01/10/21 | 422,189 | 324,990 | 0.10 |
| USD | 300,000 | CHECKERS DRIVE-IN 11% 01/12/17 144A | 327,750 | 316,500 | 0.09 |
| USD | 285,000 | DISH DBS CORP 7.875% 01/09/19 | 322,554 | 309,581 | 0.09 |
| USD | 389,000 | TERRAFORM GLOBAL 9.75% 15/08/22 144 | 383,548 | 307,310 | 0.09 |
| USD | 304,000 | MERITAGE HOMES CORP 4.5% 1/03/18 | 306,135 | 304,000 | 0.09 |
| USD | 300,000 | BANK OF AMERICA 3.875% 01/08/25 MTN | 304,592 | 303,910 | 0.09 |
| USD | 400,000 | CENTURYTEL INC 7.6% 15/09/39 P | 390,500 | 302,000 | 0.09 |
| USD | 350,000 | ASHTON WOODS USA 6.875% 15/2/21 144 | 339,985 | 301,000 | 0.09 |
| USD | 345,000 | DISH DBS CORP 5% 15/03/23 | 337,652 | 299,288 | 0.09 |
| USD | 296,000 | ONEMAIN FIN 7.25% 15/12/21 144A | 303,501 | 297,480 | 0.09 |
| USD | 300,000 | LMI AEROSPACE INC 7.375% 15/07/19 | 301,500 | 297,000 | 0.09 |
| USD | 300,000 | NCR CORP 6.375% 15/12/23 | 313,250 | 295,500 | 0.09 |
| USD | 283,000 | CABLEVISION SYSTEMS 7.75% 15/04/18 | 314,728 | 294,320 | 0.09 |
| USD | 285,000 | BOISE CASCADE CO 6.375% 01/11/20 | 299,963 | 293,550 | 0.09 |
| USD | 275,000 | CONSTELL BRANDS 7.25% 15/05/17 WI | 303,596 | 292,875 | 0.09 |
| USD | 290,000 | CHS COMMUNITY 7.125% 15/07/20 | 310,188 | 288,550 | 0.08 |
| USD | 300,000 | LTF MERGER 8.5% 15/06/23 144A | 299,000 | 286,500 | 0.08 |
| USD | 300,000 | ALLIANCE DATA SYST 5.375% 1/08/22 1 | 292,188 | 286,500 | 0.08 |
| USD | 275,000 | COTT BEVERAGES 6.75% 01/01/20 | 275,000 | 283,938 | 0.08 |
| USD | 300,000 | HP ENTERPRISE CO 6.35% 15/10/45 144 | 299,796 | 283,832 | 0.08 |
| USD | 252,000 | AVIATION CAP GR 6.75% 06/04/21 144A | 286,650 | 282,240 | 0.08 |
| USD | 274,000 | UNIVISION COMM 6.75% 15/09/22 144A | 294,040 | 281,535 | 0.08 |
| USD | 270,000 | AMERISTAR CASINOS 7.5% 15/04/21 | 284,681 | 281,475 | 0.08 |
| USD | 255,000 | REYNOLDS AMERICAN 5.85% 15/08/45 | 267,778 | 280,253 | 0.08 |
| USD | 275,000 | MPH ACQUISIT HDG 6.625% 1/04/22 14 | 281,856 | 275,688 | 0.08 |
| USD | 275,000 | CCO SAFARI II 6.484% 23/10/45 144A | 275,000 | 274,175 | 0.08 |
| USD | 270,000 | SANMINA CORP 4.375% 01/06/19 144A | 267,000 | 273,375 | 0.08 |
| USD | 256,000 | GOODYEAR TIRE&RUBBER 6.5% 01/03/21 | 271,906 | 269,120 | 0.08 |
| USD | 260,000 | ALLY FINANCIAL INC 5.5% 15/02/17 | 275,644 | 266,500 | 0.08 |
| USD | 275,000 | VPI ESCROW CORP 6.375% 15/10/20 144 | 286,688 | 265,375 | 0.08 |
| USD | 314,000 | FRONTIER COMM 7.625% 15/04/24 | 334,519 | 265,330 | 0.08 |
| USD | 257,000 | RITE AID CORP 6.125% 01/04/23 144A | 257,883 | 264,068 | 0.08 |
| USD | 294,000 | DJO FINCO LTD 8.125% 15/06/21 144A | 298,215 | 263,130 | 0.08 |
| USD | 250,000 | LANDRY'S INC 9.375% 01/05/20 144A | 269,688 | 263,125 | 0.08 |
| USD | 268,000 | CABLEVISION SYSTEMS 8% 15/04/20 | 301,715 | 259,960 | 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 | 282,000 | TARGA RESOURCES 5% 15/01/18 144A | 282,000 | 259,440 | 0.08 |
| USD | 250,000 | LEVEL 3 FIN INC 6.125% 15/1/21 | 263,750 | 258,750 | 0.08 |
| USD | 317,000 | FERRELLGAS LP 6.75% 15/06/23 144A | 317,186 | 258,355 | 0.08 |
| USD | 250,000 | JPMORGAN CHASE & CO 3.9% 15/07/25 | 255,554 | 257,072 | 0.08 |
| USD | 250,000 | DANA HOLDING CO 6.75% 15/02/21 | 265,625 | 256,875 | 0.08 |
| USD | 262,000 | FIRST CASH FIN 6.75% 01/04/21 | 276,160 | 256,760 | 0.08 |
| USD | 260,000 | AT&T INC 5.35% 01/09/40 | 276,001 | 255,895 | 0.08 |
| USD | 350,000 | UNIT CORP 6.625% 15/05/21 | 341,250 | 252,000 | 0.07 |
| USD | 250,000 | GENERAL MOTORS 3.25% 15/05/18 | 249,688 | 251,117 | 0.07 |
| USD | 235,000 | ALCATEL LUCENT 6.75% 15/11/20 144A | 237,350 | 247,631 | 0.07 |
| USD | 250,000 | WEYERHAEUSER REAL 4.375% 15/6/19 | 238,438 | 244,375 | 0.07 |
| USD | 334,000 | WHITING PETROLEUM 5.75% 15/03/21 | 297,462 | 243,820 | 0.07 |
| USD | 250,000 | BELDEN INC 5.5% 01/09/22 144A | 256,250 | 241,875 | 0.07 |
| USD | 250,000 | COMMSCOPE TECH FIN 6% 15/06/25 144A | 250,063 | 240,625 | 0.07 |
| USD | 235,000 | LIFEPOINT HEALTH 5.875% 01/12/23 | 235,000 | 239,113 | 0.07 |
| USD | 218,000 | HUGHES SATELITE 7.625% 15/06/21 | 243,538 | 231,080 | 0.07 |
| USD | 225,000 | HCA INC 4.25% 15/10/19 | 223,750 | 228,375 | 0.07 |
| USD | 290,000 | WILLIAMS PART LP 3.6% 15/03/22 | 289,907 | 227,612 | 0.07 |
| USD | 279,000 | GENWORTH FINANCIAL 7.625% 24/09/21 | 285,926 | 227,385 | 0.07 |
| USD | 291,000 | CERIDIAN CORP 11% 15/03/21 144A | 289,118 | 226,980 | 0.07 |
| USD | 275,000 | SLM CORP 6.125% 25/03/24 MTN | 281,375 | 225,500 | 0.07 |
| USD | 269,000 | CABLEVISION SYSTEMS 5.875% 15/09/22 | 260,853 | 224,615 | 0.07 |
| USD | 250,000 | HOCKEY MERG 7.875% 01/10/21 144A | 260,000 | 224,375 | 0.07 |
| USD | 257,000 | VERIZON COMMUN 4.672% 15/03/55 | 240,707 | 220,647 | 0.06 |
| USD | 250,000 | BEAZER HOMES USA 7.25% 01/02/23 | 239,250 | 220,000 | 0.06 |
| USD | 350,000 | CONSOL ENERGY 5.875% 15/04/22 | 354,375 | 217,000 | 0.06 |
| USD | 345,000 | RFCSP STRIP PRINCIPAL 0% 15/04/30 | 228,352 | 216,199 | 0.06 |
| USD | 225,000 | PRISO ACQ CORP 9% 15/05/23 144A | 225,000 | 213,750 | 0.06 |
| USD | 209,000 | BALL CORP 5.25% 01/07/25 | 209,000 | 213,703 | 0.06 |
| USD | 200,000 | AMAZON.COM IN C 4.95% 05/12/44 | 206,519 | 212,220 | 0.06 |
| USD | 200,000 | HARRON COM/FIN 9.125% 01/04/20 144A | 219,873 | 211,500 | 0.06 |
| USD | 204,000 | DAVITA INC 5.75% 15/08/22 | 217,376 | 210,120 | 0.06 |
| USD | 200,000 | NEPTUNE FINCO 10.875% 15/10/25 144A | 200,000 | 209,500 | 0.06 |
| USD | 200,000 | AMERICAN EQU INV 6.625% 15/07/21 | 213,500 | 208,000 | 0.06 |
| USD | 231,000 | PLY GEM INDS 6.5% 01/02/22 | 225,633 | 207,900 | 0.06 |
| USD | 251,000 | FRONTIER COMM 6.875% 15/01/25 | 250,063 | 206,761 | 0.06 |
| USD | 200,000 | MICROSOFT CORP 4.45% 03/11/45 | 204,210 | 204,984 | 0.06 |
| USD | 215,000 | AMERICAN AIRLINES 4.625% 11/3/20 144 | 215,000 | 204,788 | 0.06 |
| USD | 241,000 | COMM SALES&LEAS 8.25% 15/10/23 | 232,695 | 203,645 | 0.06 |
| USD | 200,000 | ASHTREAD CAPITAL 5.625% 1/10/24 144 | 204,500 | 202,500 | 0.06 |
| USD | 225,000 | CALPINE CORP 5.375% 15/01/23 | 224,025 | 201,938 | 0.06 |
| USD | 198,000 | FELCOR LODGING LP 5.625% 01/03/23 | 201,620 | 200,970 | 0.06 |
| USD | 190,000 | SONIC AUTOMOTIVE 7% 15/07/22 | 207,100 | 200,925 | 0.06 |
| USD | 200,000 | ENDO FIN LLC/FINCO 6% 15/07/23 144A | 200,000 | 199,500 | 0.06 |
| USD | 275,000 | CRESTWOOD MIDSTREAM 6% 15/12/20 | 282,219 | 199,375 | 0.06 |
| USD | 235,000 | GENESIS ENERGY LP 6.75% 01/08/22 | 232,215 | 198,575 | 0.06 |
| USD | 200,000 | ICAHN ENTS FIN 5.875% 01/02/22 | 201,750 | 196,500 | 0.06 |
| USD | 200,000 | VERIZON COMM 3.5% 01/11/24 | 199,804 | 195,784 | 0.06 |
| USD | 225,000 | DYNEGY INC 7.375% 01/11/22 WI | 212,839 | 195,750 | 0.06 |
| USD | 200,000 | BANK OF AMERICA CORP 4% 22/01/25 | 196,636 | 195,001 | 0.06 |
| USD | 202,000 | UNIVISION COMM 5.125% 15/02/25 144A | 204,434 | 194,348 | 0.06 |
| USD | 175,000 | HD SUPPLY INC 11.5% 15/07/20 | 203,469 | 193,813 | 0.06 |
| USD | 185,000 | QWEST CORP 6.75% 01/12/21 | 214,080 | 193,788 | 0.06 |
| USD | 150,000 | FHLB 5.5% 15/07/36 | 200,017 | 192,885 | 0.06 |
| USD | 200,000 | SLM CORP 4.875% 17/06/19 MTN | 204,000 | 185,000 | 0.05 |
| USD | 200,000 | XPO LOGISTICS 6.5% 15/06/22 144A | 193,750 | 185,000 | 0.05 |
| USD | 175,000 | MGM RESORTS INTL 10% 01/11/16 144A | 194,831 | 184,989 | 0.05 |
| USD | 190,000 | MORGAN STANLEY 3.95% 23/04/27 | 187,210 | 184,011 | 0.05 |
| USD | 175,000 | PINNACLE ENTERT 6.375% 01/08/21 | 184,021 | 182,875 | 0.05 |
| USD | 475,000 | HEXION US FINANCE 9% 15/11/20 | 461,326 | 181,688 | 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 | 175,000 | HERTZ CORP 5.875% 15/10/20 | 176,715 | 180,688 | 0.05 |
| USD | 283,000 | EP ENERGY/EVER 9.375% 01/05/20 | 276,463 | 180,413 | 0.05 |
| USD | 175,000 | RSI HOME PROD INC 6.5% 15/3/23 144A | 175,563 | 180,250 | 0.05 |
| USD | 175,000 | EQUINIX INC 5.375% 01/04/23 | 178,938 | 180,233 | 0.05 |
| USD | 175,000 | IPAYMENT INC 9.5% 15/12/19 144A | 158,688 | 179,922 | 0.05 |
| USD | 175,000 | EQUINIX INC 5.375% 01/01/22 | 174,256 | 179,375 | 0.05 |
| USD | 175,000 | FREESCALE SEMIC 5% 15/05/21 144A | 173,188 | 178,938 | 0.05 |
| USD | 200,000 | JEFFERIES FIN LLC 7.5% 15/04/21 144 | 200,000 | 176,000 | 0.05 |
| USD | 175,000 | SPRINT NEXTEL CORP 6% 01/12/16 | 183,625 | 174,672 | 0.05 |
| USD | 175,000 | BUILD MAT CORP 5.375% 15/11/24 144A | 175,000 | 174,563 | 0.05 |
| USD | 175,000 | JBS USA LLC 7.25% 01/06/21 144A | 184,094 | 174,125 | 0.05 |
| USD | 175,000 | REGAL ENTERTAINMENT 5.75% 15/06/23 | 168,575 | 174,125 | 0.05 |
| USD | 188,000 | PROJECT HOMESTAKE 8.875% 1/3/23 144 | 190,381 | 173,900 | 0.05 |
| USD | 175,000 | ALLY FINANCIAL INC 3.25% 05/11/18 | 174,752 | 171,719 | 0.05 |
| USD | 175,000 | NEXSTAR BROAD 6.125% 15/02/22 144A | 175,844 | 171,500 | 0.05 |
| USD | 500,000 | AVAYA INC 10.5% 01/03/21 144A | 452,500 | 170,000 | 0.05 |
| USD | 172,000 | KB HOME 7.625% 15/05/23 | 172,000 | 169,850 | 0.05 |
| USD | 173,000 | CHOCTAW RESORT 7.25% 15/11/19 144A | 170,096 | 166,945 | 0.05 |
| USD | 163,000 | ALLY FINANCIAL INC 5.75% 20/11/25 | 161,476 | 165,038 | 0.05 |
| USD | 161,000 | T-MOBILE USA 6.625% 01/04/23 | 170,193 | 164,220 | 0.05 |
| USD | 200,000 | ACCESS MIDST PART 4.875% 15/05/23 | 206,375 | 162,728 | 0.05 |
| USD | 235,000 | GLENCORE FDG LLC 4% 16/04/25 144A | 201,076 | 162,150 | 0.05 |
| USD | 157,000 | HOLOGIC INC 5.25% 15/07/22 144A | 159,210 | 160,140 | 0.05 |
| USD | 156,000 | NUSTAR LOGISTICS 7.65% 15/04/18 | 176,800 | 159,315 | 0.05 |
| USD | 167,000 | HEALTHSOUTH CORP 5.75% 1/11/24 144A | 167,835 | 159,276 | 0.05 |
| USD | 175,000 | ITALICS MERGER 7.125% 15/07/23 144A | 175,000 | 157,938 | 0.05 |
| USD | 150,000 | HCA HLDG 6.25% 15/02/21 | 159,938 | 157,875 | 0.05 |
| USD | 155,000 | TENET HEALTHCARE 8.125% 1/4/22 | 172,825 | 153,063 | 0.04 |
| USD | 153,000 | FIRST DATA CORP 7% 01/12/23 144A | 153,375 | 152,235 | 0.04 |
| USD | 150,000 | SALLY HDGS/CAP 5.625% 01/12/25 | 151,313 | 151,875 | 0.04 |
| USD | 195,000 | GLENCORE FDG LLC 2.875% 16/04/20 14 | 194,811 | 151,125 | 0.04 |
| USD | 150,000 | BLUE COAT HDG 8.375% 01/06/23 144A | 150,313 | 150,750 | 0.04 |
| USD | 132,000 | ALLY FINANCIAL INC 7.5% 15/09/20 WI | 153,080 | 149,325 | 0.04 |
| USD | 145,000 | AMER AIRLN 13-1 C 6.125% 15/07/18 1 | 151,888 | 148,806 | 0.04 |
| USD | 175,000 | DYNEGY INC 7.625% 01/11/24 WI | 172,731 | 148,750 | 0.04 |
| USD | 175,000 | WINDSTREAM CORP 7.75% 15/10/20 | 187,253 | 148,750 | 0.04 |
| USD | 150,000 | ARGOS MERGER 7.125% 15/03/23 144A | 153,475 | 148,725 | 0.04 |
| USD | 150,000 | ICAHN ENTR/FIN 4.875% 15/03/19 WI | 149,813 | 148,650 | 0.04 |
| USD | 150,000 | AMKOR TECHNO INC 6.375% 01/10/22 | 158,250 | 145,875 | 0.04 |
| USD | 175,000 | HARLAND CLARKE 6.875% 01/03/20 144A | 178,219 | 145,250 | 0.04 |
| USD | 213,000 | GENWORTH HDGS INC 4.9% 15/08/23 | 173,948 | 144,840 | 0.04 |
| USD | 175,000 | OUTERWALL 5.875% 15/06/21 | 165,813 | 143,500 | 0.04 |
| USD | 175,000 | ENERGY TRANSFER EQ 5.875% 15/01/24 | 171,273 | 142,625 | 0.04 |
| USD | 155,000 | CONCHO RESOURCES 5.5% 01/04/23 | 151,513 | 142,600 | 0.04 |
| USD | 161,000 | CALPINE CORP 5.75% 15/01/25 | 163,801 | 142,083 | 0.04 |
| USD | 195,000 | COMPRESSCO PART 7.25% 15/08/22 | 180,000 | 140,400 | 0.04 |
| USD | 140,000 | CCOH SAFARI 5.75% 15/02/26 144A | 140,000 | 140,175 | 0.04 |
| USD | 150,000 | HARLAND CLARKE 9.75% 01/08/18 144A | 160,688 | 138,750 | 0.04 |
| USD | 121,000 | ALLY FINANCIAL INC 8% 15/03/20 | 143,990 | 137,940 | 0.04 |
| USD | 150,000 | TOWNSQUARE MEDIA 6.5% 01/04/23 144A | 150,429 | 137,250 | 0.04 |
| USD | 160,000 | MERITOR INC 6.25% 15/02/24 | 161,151 | 136,800 | 0.04 |
| USD | 130,000 | ENTERTAINMENT PROP 5.75% 15/08/22 | 143,918 | 136,228 | 0.04 |
| USD | 134,000 | HCA INC 5.875% 15/02/26 | 134,335 | 134,335 | 0.04 |
| USD | 133,000 | US AIRWAY 12-2C PTT 5.45% 03/06/18 | 134,663 | 134,330 | 0.04 |
| USD | 150,000 | RR DONNELLEY 6% 01/04/24 | 145,875 | 133,875 | 0.04 |
| USD | 183,000 | SPRINT CORP 7.625% 15/02/25 | 183,000 | 132,767 | 0.04 |
| USD | 128,000 | L BRANDS 6.875% 01/11/35 144A | 128,225 | 131,360 | 0.04 |
| USD | 125,000 | POST HLDGS 7.75% 15/03/24 144A | 125,000 | 130,625 | 0.04 |
| USD | 183,000 | MENS WEARHOUSE 7% 01/07/22 | 180,874 | 129,930 | 0.04 |
| USD | 125,000 | NATHAN'S FAMOUS 10% 15/03/20 144A | 129,000 | 129,688 | 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 | 125,000 | TEAMHEALTH INC 7.25% 15/12/23 144A | 128,609 | 129,531 | 0.04 |
| USD | 125,000 | US FOODSERVICE 8.50% 30/06/19 | 131,459 | 129,063 | 0.04 |
| USD | 161,000 | WPX ENERGY INC 8.25% 01/08/23 | 161,650 | 128,800 | 0.04 |
| USD | 195,000 | SM ENERGY CO 5.625% 01/06/25 | 195,000 | 128,700 | 0.04 |
| USD | 125,000 | MGM MIRAGE INC 7.5% 01/06/16 | 133,625 | 127,305 | 0.04 |
| USD | 129,000 | KB HOME 7% 15/12/21 | 130,040 | 127,226 | 0.04 |
| USD | 125,000 | LEVEL 3 FIN INC 5.625% 01/02/23 | 125,568 | 127,188 | 0.04 |
| USD | 175,000 | RICE ENERGY 7.25% 01/05/23 144A | 175,273 | 126,875 | 0.04 |
| USD | 138,000 | BEAZER HOMES USA 7.5% 15/09/21 | 135,663 | 126,615 | 0.04 |
| USD | 125,000 | PLATFORM SPEC 10.375% 01/05/21 144A | 128,151 | 124,688 | 0.04 |
| USD | 125,000 | HCA INC 4.75% 01/05/23 | 124,219 | 124,063 | 0.04 |
| USD | 125,000 | CITIGROUP INC 4.45% 29/09/27 | 123,609 | 123,838 | 0.04 |
| USD | 125,000 | WILLIAM LYON HOM 5.75% 15/04/19 | 125,625 | 123,125 | 0.04 |
| USD | 125,000 | ESH HOSPITALITY 5.25% 01/05/25 144A | 125,647 | 121,875 | 0.04 |
| USD | 125,000 | OMEGA HEALTH INV 4.5% 15/01/25 | 123,914 | 121,689 | 0.04 |
| USD | 125,000 | CORPORATE OFF 3.7% 15/06/21 | 125,699 | 121,441 | 0.04 |
| USD | 124,000 | UNITED RENTALS 5.5% 15/07/25 | 124,147 | 120,900 | 0.04 |
| USD | 125,000 | RADIAN GROUP INC 5.25% 15/06/20 | 125,000 | 120,900 | 0.04 |
| USD | 132,000 | CLEAR CHANNEL WORL 7.625% 15/3/20 A | 137,610 | 120,780 | 0.04 |
| USD | 125,000 | TESORO LOGISTICS 5.875% 1/10/20 | 129,688 | 120,000 | 0.04 |
| USD | 150,000 | NWH ESCROW CORP 7.5% 01/08/21 144a | 141,000 | 120,000 | 0.04 |
| USD | 125,000 | CENTURYLINK INC 6.75% 01/12/23 W | 125,563 | 118,188 | 0.03 |
| USD | 150,000 | KINDER MORGAN INC 5.55% 01/06/45 | 148,352 | 116,464 | 0.03 |
| USD | 117,000 | FIRST DATA CORP 5.75% 15/01/24 144A | 117,000 | 114,075 | 0.03 |
| USD | 150,000 | SEAGATE HDD CAY 4.875% 01/06/27 144 | 149,577 | 113,495 | 0.03 |
| USD | 140,000 | TRIUMPH GROUP 5.25% 01/06/22 | 139,650 | 112,700 | 0.03 |
| USD | 116,000 | PILGRIM'S PRI 5.75% 15/03/25 144A | 116,000 | 112,520 | 0.03 |
| USD | 118,000 | ICON HEALTH FIT 11.875% 15/10/16 14 | 118,000 | 112,100 | 0.03 |
| USD | 193,000 | EVOLUTION ESC 7.5% 15/03/22 144A | 193,000 | 111,940 | 0.03 |
| USD | 133,000 | ONEOK INC 7.5% 01/09/23 | 131,177 | 111,055 | 0.03 |
| USD | 115,000 | CITGO PETROLEUM 6.25% 15/08/22 144A | 121,025 | 110,400 | 0.03 |
| USD | 112,000 | LIVE NATION ENT 5.375% 15/06/22 144 | 113,400 | 110,320 | 0.03 |
| USD | 125,000 | CALPINE CORP 5.5% 01/02/24 | 125,000 | 110,313 | 0.03 |
| USD | 125,000 | MIRCON TECH INC 5.25% 15/01/24 144A | 124,974 | 110,000 | 0.03 |
| USD | 125,000 | SELECT MEDICAL 6.375% 01/06/21 | 126,396 | 109,844 | 0.03 |
| USD | 125,000 | LAREDO PETROLEUM INC 6.25% 15/03/23 | 125,938 | 108,750 | 0.03 |
| USD | 120,000 | HUNTSMAN INTL 5.125% 15/11/22 144A | 118,600 | 108,000 | 0.03 |
| USD | 123,000 | KRONOS ACQUISITION 9% 15/08/23 144A | 110,171 | 105,165 | 0.03 |
| USD | 125,000 | NRG ENERGY 6.25% 01/05/24 WI | 115,250 | 105,025 | 0.03 |
| USD | 100,000 | CVS HEALTH CORP 5.125% 20/07/45 | 106,452 | 104,779 | 0.03 |
| USD | 125,000 | KINDRED HEALTH 6.375% 15/04/22 | 126,128 | 103,750 | 0.03 |
| USD | 96,000 | HUGHES SATELITE 6.5% 15/06/19 | 104,553 | 103,560 | 0.03 |
| USD | 119,000 | CARRIZO OIL&GAS INC 7.5% 15/09/20 | 120,260 | 103,530 | 0.03 |
| USD | 100,000 | WELLCARE HEALTH 5.75% 15/11/20 | 104,500 | 103,250 | 0.03 |
| USD | 99,000 | FAMILY TREE ESC 5.75% 01/03/23 144A | 99,715 | 102,960 | 0.03 |
| USD | 148,000 | IHEART COM 10.625% 15/03/23 | 147,108 | 102,860 | 0.03 |
| USD | 99,000 | ARAMARK CORP 5.75% 15/03/20 | 103,339 | 102,403 | 0.03 |
| USD | 100,000 | GRAY TELEVISION INC 7.5% 01/10/20 | 104,438 | 102,000 | 0.03 |
| USD | 100,000 | SEALED AIR CORP 5.5% 15/09/25 144A | 100,000 | 102,000 | 0.03 |
| USD | 100,000 | LEVEL 3 COMM 5.75% 01/12/22 WI | 100,107 | 102,000 | 0.03 |
| USD | 97,000 | FIRST DATA CORP 6.75% 01/11/20 144A | 102,456 | 101,608 | 0.03 |
| USD | 134,000 | WISE METALS GRP 8.75% 15/12/18 144A | 126,993 | 101,505 | 0.03 |
| USD | 100,000 | NAI ENTER HLDGS 5% 01/08/18 144A | 103,250 | 101,500 | 0.03 |
| USD | 100,000 | HCA INC 5.25% 15/04/25 | 100,375 | 101,000 | 0.03 |
| USD | 125,000 | MARATHON OIL CORP 3.85% 01/06/25 | 108,541 | 100,335 | 0.03 |
| USD | 100,000 | DANA HOLDING CO 6% 15/09/23 | 105,583 | 100,250 | 0.03 |
| USD | 100,000 | CATERPILLAR FIN 2.25% 01/12/19 MTN | 99,920 | 100,099 | 0.03 |
| USD | 161,000 | K HOVNANIAN ENT 8% 01/11/19 144A | 161,000 | 99,820 | 0.03 |
| USD | 150,000 | RUE21 INC 9% 15/10/21 144A | 120,875 | 99,000 | 0.03 |
| USD | 100,000 | CITIGROUP INC 3.3% 27/04/25 | 97,100 | 97,924 | 0.03 |

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|--------|---------|
| USD | 100,000 | NATIONSTAR MORT/CAP 6.5% 01/08/18 | 100,750 | 97,750 | 0.03 |
| USD | 100,000 | TRANSDIGM INC 6% 15/07/22 | 99,250 | 97,750 | 0.03 |
| USD | 100,000 | OWENS-BROCKWAY 5.375% 15/01/25 144A | 101,000 | 97,750 | 0.03 |
| USD | 95,000 | OWENS-BROCKWAY 6.375% 15/08/25 144A | 95,000 | 97,613 | 0.03 |
| USD | 100,000 | CNH CAPITAL L 3.875% 16/07/18 | 99,642 | 97,312 | 0.03 |
| USD | 100,000 | REGAL ENTERTAINMENT 5.75% 01/02/25 | 93,500 | 96,500 | 0.03 |
| USD | 103,000 | HEALTHSOUTH CORP 5.75% 15/09/25 144 | 103,000 | 95,790 | 0.03 |
| USD | 100,000 | SPRINGLEAF FINANCE 6% 01/06/20 WI | 99,000 | 95,000 | 0.03 |
| USD | 90,000 | UNITED RENTALS 7.375% 15/05/20 | 97,705 | 94,950 | 0.03 |
| USD | 120,000 | KINDER MORGAN 5.5% 01/03/44 | 113,872 | 94,229 | 0.03 |
| USD | 133,000 | WEATHERFORD INTL 6.8% 15/06/37 | 97,820 | 93,100 | 0.03 |
| USD | 150,000 | JC PENNEY CORP INC 6.375% 15/10/36 | 132,563 | 93,000 | 0.03 |
| USD | 91,000 | OWENS-BROCKWAY 5.875% 15/08/23 144A | 90,289 | 92,365 | 0.03 |
| USD | 100,000 | EMDEON INC 6% 15/02/21 144A | 100,000 | 92,250 | 0.03 |
| USD | 87,000 | TEMPUR SEALY INTL 6.875% 15/12/20 | 93,528 | 91,785 | 0.03 |
| USD | 110,000 | KINDER MORGAN ENE 6.5% 01/09/39 | 127,018 | 90,902 | 0.03 |
| USD | 625,000 | LINN ENERGY LLC/FIN 7.75% 1/2/21 | 611,364 | 90,625 | 0.03 |
| USD | 100,000 | HUNT COS INC 9.625% 01/03/21 144A | 102,750 | 90,500 | 0.03 |
| USD | 105,000 | PLAINS ALL AMER PIP 4.65% 15/10/25 | 102,589 | 90,298 | 0.03 |
| USD | 110,000 | ENERGY TRANSF PARTN 6.5% 01/02/42 | 129,600 | 89,207 | 0.03 |
| USD | 100,000 | ANNA MERGER SUB 7.75% 01/10/22 144A | 101,917 | 88,250 | 0.03 |
| USD | 75,000 | RITE AID CORP 7.7% 15/02/27 | 85,375 | 87,375 | 0.03 |
| USD | 150,000 | FREEMPORT-MCMORAN 4.55% 14/11/24 | 146,319 | 87,000 | 0.03 |
| USD | 100,000 | JBS USA LLC 5.75% 15/06/25 144A | 100,000 | 87,000 | 0.03 |
| USD | 105,000 | HEXION INC 10% 15/04/20 | 105,000 | 86,625 | 0.03 |
| USD | 100,000 | PLATFORM SPECIAL 6.5% 1/2/22 144A | 87,800 | 86,500 | 0.03 |
| USD | 108,000 | ANTERO RESOURCE FIN 5.375% 01/11/21 | 105,512 | 86,400 | 0.03 |
| USD | 85,000 | TEMPUR SEALY INTL 5.625% 15/10/23 1 | 85,000 | 86,364 | 0.03 |
| USD | 86,000 | FIRST DATA CORP 5% 15/01/24 144A | 86,000 | 85,785 | 0.03 |
| USD | 84,000 | EARTHLINK 8.875% 15/05/19 | 84,341 | 85,260 | 0.03 |
| USD | 100,000 | NRG ENERGY INC 6.25% 15/07/22 | 96,125 | 85,200 | 0.03 |
| USD | 100,000 | CONSOLIDATED COMM 6.5% 01/10/22 | 98,695 | 84,000 | 0.02 |
| USD | 88,000 | TENET HEALTHCARE 6.75% 15/06/23 | 88,206 | 81,125 | 0.02 |
| USD | 75,000 | RITE AID CORP 9.25% 15/03/20 | 82,875 | 79,406 | 0.02 |
| USD | 80,000 | EDUCATION REALT 4.6% 01/12/24 | 79,993 | 78,581 | 0.02 |
| USD | 100,000 | HARLAND CLARKE 9.25% 01/03/21 144A | 102,750 | 78,500 | 0.02 |
| USD | 75,000 | SIRIUS XM RADIO 6% 15/07/24 144A | 77,231 | 78,375 | 0.02 |
| USD | 95,000 | VIACOM INC 5.25% 01/04/44 | 100,425 | 78,056 | 0.02 |
| USD | 75,000 | SPECTRUM BRANDS 6.125% 15/12/24 144 | 75,000 | 78,000 | 0.02 |
| USD | 75,000 | BUILDING MATERIALS 9% 15/09/18 144A | 76,688 | 78,000 | 0.02 |
| USD | 75,000 | DEAN FOODS 6.5% 15/03/23 144A | 75,000 | 78,000 | 0.02 |
| USD | 75,000 | NORTEK INC 8.5% 15/04/21 | 80,656 | 77,820 | 0.02 |
| USD | 75,000 | SYSCO CORP 4.85% 01/10/45 | 77,921 | 77,656 | 0.02 |
| USD | 75,000 | MSCI INC 5.75% 15/08/25 144A | 75,000 | 76,875 | 0.02 |
| USD | 75,000 | CARMIKE CINEMAS INC 6% 15/6/23 144A | 75,150 | 76,875 | 0.02 |
| USD | 75,000 | CALPINE CORP 5.875% 15/01/24 144A | 80,250 | 76,875 | 0.02 |
| USD | 77,000 | ALLY FINANCIAL INC 3.25% 13/02/18 | 76,456 | 76,615 | 0.02 |
| USD | 75,000 | FELCOR LODGING LP 6% 01/06/25 | 75,000 | 76,125 | 0.02 |
| USD | 75,000 | LEVEL 3 FINANCING 5.375% 15/1/24 14 | 75,000 | 75,938 | 0.02 |
| USD | 75,000 | MIDCONTINENT COM 6.875% 15/08/23 14 | 75,000 | 75,938 | 0.02 |
| USD | 75,000 | RCN TELE SER CAP 8.5% 15/08/20 144A | 79,063 | 75,750 | 0.02 |
| USD | 74,000 | BALL CORP 4.375% 15/12/20 | 74,000 | 75,573 | 0.02 |
| USD | 100,000 | SPRINT CORP 7.25% 15/09/21 | 99,500 | 75,470 | 0.02 |
| USD | 75,000 | LOGO MERGER SUB 8.375% 15/10/20 144 | 75,563 | 75,375 | 0.02 |
| USD | 75,000 | AMC ENTERTAINMT 5.75% 15/06/25 | 75,000 | 75,375 | 0.02 |
| USD | 75,000 | CHURCHILL DOWNS 5.375% 15/12/21 144 | 75,750 | 75,188 | 0.02 |
| USD | 75,000 | MORGAN STANLEY 4.35% 08/09/26 MTN | 76,188 | 75,044 | 0.02 |
| USD | 75,000 | CHS/COMM HEALTH 5.125% 15/08/18 | 77,468 | 74,993 | 0.02 |
| USD | 75,000 | MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 | 75,000 | 74,813 | 0.02 |
| USD | 75,000 | LANDRY'S HDGS II 10.25% 01/01/18 14 | 77,438 | 74,813 | 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 | 75,000 | HALYARD HEALTH 6.25% 15/10/22 | 75,531 | 74,625 | 0.02 |
| USD | 75,000 | LADDER CAP FIN 7.375% 01/10/17 | 77,625 | 74,625 | 0.02 |
| USD | 75,000 | CINEMARK USA 5.125% 15/12/22 | 75,188 | 74,438 | 0.02 |
| USD | 89,000 | GENWORTH FINANCIAL 7.2% 15/02/21 | 85,663 | 74,315 | 0.02 |
| USD | 75,000 | SPEEDWAY MOTORSP 5.125% 01/02/23 | 75,000 | 74,250 | 0.02 |
| USD | 75,000 | HRG GROUP 7.75% 15/01/22 144@ | 73,883 | 74,250 | 0.02 |
| USD | 75,000 | HALLIBURTON CO 5% 15/11/45 | 75,971 | 73,956 | 0.02 |
| USD | 75,000 | NIELSEN FIN LLC 5% 15/04/22 144A | 75,555 | 73,875 | 0.02 |
| USD | 75,000 | CPG MERGER SUB 8% 01/10/21 144A | 79,125 | 73,500 | 0.02 |
| USD | 70,000 | NRG ENERGY INC 7.625% 15/01/18 | 77,700 | 73,325 | 0.02 |
| USD | 75,000 | COGENT COM 5.375% 01/03/22 144A | 75,000 | 72,938 | 0.02 |
| USD | 75,000 | ELDORADO RES INC 7% 01/08/23 144A | 75,000 | 72,750 | 0.02 |
| USD | 100,000 | WHITING PETR 6.25% 01/04/23 | 100,550 | 72,000 | 0.02 |
| USD | 84,000 | TARGA RESOURCES 6.75% 15/03/24 144A | 84,000 | 71,400 | 0.02 |
| USD | 75,000 | TENET HEALTHCARE 5% 01/03/19 | 76,500 | 70,313 | 0.02 |
| USD | 100,000 | SPRINT CAP CORP 6.875% 15/11/28 | 92,029 | 69,500 | 0.02 |
| USD | 75,000 | PBF LOGIST LP/FIN 6.875% 15/5/23 WI | 75,000 | 69,000 | 0.02 |
| USD | 75,000 | PATRIOT MERGER CORP 9% 15/07/21 144 | 74,625 | 68,625 | 0.02 |
| USD | 450,000 | WARREN RESOURCES 9% 01/08/22 | 282,375 | 67,500 | 0.02 |
| USD | 125,000 | SANCHEZ ENERY CORP 6.125% 15/1/23 | 117,084 | 67,500 | 0.02 |
| USD | 95,000 | ROSE ROCK MIND 5.625% 15/11/23 144A | 93,428 | 67,450 | 0.02 |
| USD | 75,000 | CEQUEL COM HLD 5.125% 15/12/21 144A | 68,813 | 67,313 | 0.02 |
| USD | 70,000 | ENSEMBLE S MERGER 9% 30/09/23 144A | 67,598 | 67,200 | 0.02 |
| USD | 100,000 | SM ENERGY CO 5% 15/01/24 | 85,500 | 65,000 | 0.02 |
| USD | 100,000 | K HOVNANIAN ENT 7% 15/01/19 144A | 100,000 | 64,000 | 0.02 |
| USD | 75,000 | ECO SERVICES 8.5% 01/11/22 144A | 75,000 | 63,750 | 0.02 |
| USD | 75,000 | ANTERO RESOURCE FIN 6% 01/12/20 | 75,000 | 62,625 | 0.02 |
| USD | 75,000 | TARGA RESOURCES 4.125% 15/11/19 | 75,000 | 62,250 | 0.02 |
| USD | 70,000 | ANADARKO PETRO CORP 3.45% 15/07/24 | 60,709 | 62,049 | 0.02 |
| USD | 69,000 | NAVIENT CORP 5% 26/10/20 | 68,562 | 60,720 | 0.02 |
| USD | 75,000 | GENON ENERGY INC 9.5% 15/10/18 | 78,150 | 60,587 | 0.02 |
| USD | 50,000 | TENN VALLEY AUTH 5.25% 15/09/39 | 65,202 | 59,565 | 0.02 |
| USD | 62,000 | HEALTHSOUTH CORP 5.75% 01/11/24 | 59,699 | 59,133 | 0.02 |
| USD | 50,000 | GMAC 8% 01/11/31 | 58,500 | 58,750 | 0.02 |
| USD | 75,000 | ANTERO RESOURCE 5.625% 1/6/23 144A | 75,000 | 58,500 | 0.02 |
| USD | 57,000 | FRONTIER COMM 11% 15/09/25 144A | 56,850 | 56,573 | 0.02 |
| USD | 75,000 | WINDSTREAM CORP 7.50% 01/04/23 | 67,500 | 56,250 | 0.02 |
| USD | 193,000 | CHESAPEAKE ENERGY 6.625% 15/08/20 | 185,356 | 55,488 | 0.02 |
| USD | 50,000 | VERIZON COMM 5.15% 15/09/23 | 55,747 | 54,706 | 0.02 |
| USD | 65,000 | APACHE CORP 4.75% 15/04/43 | 55,163 | 54,090 | 0.02 |
| USD | 75,000 | WINDSTREAM CORP 6.375% 01/08/23 | 72,563 | 53,813 | 0.02 |
| USD | 80,000 | K HOVNANIAN ENT 9.125% 15/11/20 144 | 86,800 | 53,700 | 0.02 |
| USD | 50,000 | INTL LEASE FIN CORP 5.875% 01/04/19 | 53,625 | 53,000 | 0.02 |
| USD | 50,000 | BUILDERS FIRSTS 7.625% 01/06/21 144 | 51,000 | 52,625 | 0.02 |
| USD | 50,000 | HRG GROUP 7.875% 15/07/19 144a | 52,250 | 52,625 | 0.02 |
| USD | 50,000 | CABLEVISION SYSTEMS 8.625% 15/09/17 | 52,125 | 52,500 | 0.02 |
| USD | 50,000 | AMC NETWORKS INC 7.75% 15/07/21 WI | 55,250 | 52,500 | 0.02 |
| USD | 50,000 | MERITAGE HOMES CORP 7% 01/04/22 | 52,250 | 52,375 | 0.02 |
| USD | 50,000 | TIME WARNER CABLE 5.85% 01/05/17 | 53,344 | 52,298 | 0.02 |
| USD | 185,000 | CHESAPEAKE ENERGY 6.125% 15/02/21 | 170,868 | 52,263 | 0.02 |
| USD | 50,000 | GREYSTAR REAL 8.25% 01/12/22 144A | 50,000 | 51,875 | 0.02 |
| USD | 50,000 | SABRA HEALTH 5.5% 01/02/21 | 49,750 | 51,875 | 0.02 |
| USD | 50,000 | SS&C TECH HOLD 5.875% 15/07/23 144A | 50,000 | 51,625 | 0.02 |
| USD | 50,000 | CYRUSONE LP/FIN 6.375% 15/11/22 | 52,125 | 51,500 | 0.02 |
| USD | 50,000 | NETFLIX INC 5.5% 15/02/22 144A | 50,208 | 51,250 | 0.02 |
| USD | 50,000 | BEACON ROOF 6.375% 01/10/23 144A | 50,000 | 50,938 | 0.01 |
| USD | 50,000 | POST HLDGS 6.75% 01/12/21 144A | 49,375 | 50,875 | 0.01 |
| USD | 300,000 | LINN ENERGY LLC 8.625% 15/4/20 | 204,369 | 50,625 | 0.01 |
| USD | 50,000 | FRESENIUS MED 4.125% 15/10/20 144A | 50,000 | 50,500 | 0.01 |
| USD | 50,000 | CENTRAL GARDEN PET 6.125% 15/11/23 | 50,000 | 50,500 | 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 | AFFINITY GAMING 9% 15/05/18 | 50,094 | 50,500 | 0.01 |
| USD | 50,000 | BANKRATE INC 6.125% 15/08/18 144A | 49,500 | 50,500 | 0.01 |
| USD | 50,000 | WR GRACE & CO 5.125% 01/10/21 144A | 50,000 | 50,500 | 0.01 |
| USD | 50,000 | ABC SUPPLY 5.75% 15/12/23 144A | 50,000 | 50,375 | 0.01 |
| USD | 50,000 | WELLS FARGO & CO 3.55% 29/9/25 MTN | 49,913 | 50,352 | 0.01 |
| USD | 50,000 | GOLDEN NUGGET ESC 8.5% 01/12/21 144 | 50,063 | 50,250 | 0.01 |
| USD | 50,000 | DISH DBS CORP 7.125% 01/02/16 | 51,938 | 50,157 | 0.01 |
| USD | 50,000 | WILLIAM LYON HOME 7% 15/08/22 144a | 51,000 | 50,125 | 0.01 |
| USD | 50,000 | MERCER INTL 7% 01/12/19 | 50,000 | 50,125 | 0.01 |
| USD | 50,000 | TESORO CORP 5.375% 01/10/22 | 51,125 | 50,000 | 0.01 |
| USD | 50,000 | RHP HOTEL /RHP FIN 5% 15/04/23 | 50,000 | 50,000 | 0.01 |
| USD | 50,000 | SEALED AIR CORP 5.125% 1/12/24 144A | 50,000 | 50,000 | 0.01 |
| USD | 50,000 | CCO HLDGS LLC 5.125% 01/05/23 144A | 50,000 | 49,938 | 0.01 |
| USD | 50,000 | EXAMWORKS GROUP INC 5.625% 15/04/23 | 50,675 | 49,875 | 0.01 |
| USD | 50,000 | ENERSYS 5% 30/04/23 144A | 50,000 | 49,750 | 0.01 |
| USD | 50,000 | LENNAR CORP 4.875% 15/12/23 | 49,585 | 49,750 | 0.01 |
| USD | 50,000 | JPMORGAN CHASE & CO 3.875% 10/09/24 | 49,773 | 49,665 | 0.01 |
| USD | 50,000 | CEB INC 5.625% 15/06/23 144A | 50,000 | 49,625 | 0.01 |
| USD | 50,000 | STANDARDAERO AVIAT 10% 15/07/23 144 | 49,325 | 49,625 | 0.01 |
| USD | 50,000 | CCO SAFARI II 3.579% 23/07/20 144A | 49,906 | 49,579 | 0.01 |
| USD | 50,000 | CELGENE CORP 3.875% 15/08/25 | 50,233 | 49,504 | 0.01 |
| USD | 50,000 | MULTI-COLOR 6.125% 01/12/22 144A | 50,000 | 49,500 | 0.01 |
| USD | 50,000 | GROUP 1 AUTO 5.25% 15/12/23 144A | 50,000 | 49,500 | 0.01 |
| USD | 50,000 | 21ST CENTURY FOX 4.95% 15/10/45 144 | 50,736 | 49,052 | 0.01 |
| USD | 75,000 | TPC GROUP INC 8.75% 15/12/20 144A | 67,813 | 48,750 | 0.01 |
| USD | 50,000 | NRG ENERGY INC 8.25% 01/09/20 | 47,688 | 48,750 | 0.01 |
| USD | 50,000 | JAGUAR HL/PPDI 6.375% 01/08/23 144A | 49,500 | 48,625 | 0.01 |
| USD | 50,000 | JP MORGAN CHASE 3.125% 23/01/25 | 48,867 | 48,503 | 0.01 |
| USD | 50,000 | VALEANT PHARMA 6.75% 15/08/21 144A | 52,313 | 48,500 | 0.01 |
| USD | 50,000 | WELLS FARGO&CO 3% 19/02/25 MTN | 48,031 | 48,475 | 0.01 |
| USD | 50,000 | ARUBA INV 8.75% 15/02/23 144A | 50,000 | 48,250 | 0.01 |
| USD | 50,000 | MEDIACOM LLC/CORP 5.5% 15/04/21 | 50,750 | 48,125 | 0.01 |
| USD | 50,000 | A SCHULMAN INC 6.875% 01/06/23 144A | 50,000 | 47,875 | 0.01 |
| USD | 50,000 | WAVEDIVISION ESC 8.125% 1/09/20 144 | 53,000 | 47,813 | 0.01 |
| USD | 50,000 | REYNOLDS AMERICAN 4.75% 01/11/42 | 47,711 | 47,532 | 0.01 |
| USD | 50,000 | KLX INC 5.875% 01/12/22 144A | 49,698 | 47,500 | 0.01 |
| USD | 50,000 | VERIZON COMM 4.862% 21/08/46 | 49,376 | 47,114 | 0.01 |
| USD | 50,000 | ALERE INC 6.375% 01/07/23 144A | 50,000 | 46,750 | 0.01 |
| USD | 50,000 | INN MOUNTAIN GODS 8.75% 30/11/20 14 | 46,750 | 46,250 | 0.01 |
| USD | 50,000 | KINDRED HEALTH 8.75% 15/01/23 | 50,042 | 45,938 | 0.01 |
| USD | 54,000 | FRONTIER COMM 9% 15/08/31 | 46,980 | 45,630 | 0.01 |
| USD | 50,000 | UNIVAR INC 6.75% 15/07/23 144A | 50,000 | 45,500 | 0.01 |
| USD | 61,000 | SM ENERGY CO 6.125% 15/11/22 | 58,611 | 44,835 | 0.01 |
| USD | 50,000 | BLUELINE RENTAL FIN 7% 01/02/19 144 | 51,250 | 44,125 | 0.01 |
| USD | 50,000 | VERIZON COMM 4.522% 15/09/48 | 45,664 | 43,960 | 0.01 |
| USD | 50,000 | LAREDO PETROLEUM 5.625% 15/01/22 | 43,125 | 43,500 | 0.01 |
| USD | 50,000 | MIRCON TECH INC 5.625 15/1/26 144A | 50,000 | 43,375 | 0.01 |
| USD | 45,000 | SCIENTIFIC GAMES INTL 7% 1/1/22 144 | 45,000 | 42,975 | 0.01 |
| USD | 46,000 | MERITOR INC 6.75% 15/06/21 | 46,575 | 42,320 | 0.01 |
| USD | 65,000 | OASIS PETROLEUM 6.875% 15/03/22 | 58,065 | 41,600 | 0.01 |
| USD | 41,000 | INFOR US INC 5.75% 15/08/20 144A | 40,590 | 41,308 | 0.01 |
| USD | 50,000 | ACCURIDE CORP 9.5% 01/08/18 | 52,500 | 41,250 | 0.01 |
| USD | 39,000 | POST HLDGS 8% 15/07/25 144A | 39,000 | 41,243 | 0.01 |
| USD | 50,000 | INTREPID AVIATION 6.875% 15/2/19 14 | 45,875 | 41,000 | 0.01 |
| USD | 50,000 | CARRIZO OIL&GAS INC 6.25% 15/04/23 | 50,000 | 40,625 | 0.01 |
| USD | 50,000 | TERRAFORM POWER 6.125% 15/06/25 144 | 38,875 | 39,875 | 0.01 |
| USD | 76,000 | SPEEDY CASH 10.75% 15/05/18 144A | 54,288 | 39,520 | 0.01 |
| USD | 100,000 | AK STEEL CORP 8.375% 01/04/22 | 95,375 | 39,500 | 0.01 |
| USD | 50,000 | CLEAR CHANNEL COMM 9% 15/12/19 | 49,688 | 36,500 | 0.01 |
| USD | 50,000 | RESOLUTE FOREST 5.875% 15/05/23 | 48,250 | 36,406 | 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 | 75,000 | US STEEL CORP 6.875% 01/04/21 | 71,250 | 35,250 | 0.01 |
| USD | 50,000 | HECLA MINING CO 6.875% 01/05/21 | 46,844 | 34,625 | 0.01 |
| USD | 50,000 | BLUE RACER MID 6.125% 15/11/22 144A | 49,988 | 34,500 | 0.01 |
| USD | 50,000 | HALCON RES CORP 8.625% 01/02/20 144 | 42,625 | 34,500 | 0.01 |
| USD | 50,000 | SUNGARD AVAIL 8.75% 01/04/22 144A | 34,875 | 34,000 | 0.01 |
| USD | 50,000 | NORTHERN OIL AND GAS 8% 01/06/20 | 47,500 | 33,250 | 0.01 |
| USD | 97,000 | DENBURY RES 5.5% 01/05/22 | 91,223 | 31,525 | 0.01 |
| USD | 50,000 | SUNCOKE ENERGY 7.375% 01/02/20 144A | 51,000 | 31,000 | 0.01 |
| USD | 75,000 | 99 CENTS ONLY STORE 11% 15/12/19 W1 | 62,688 | 30,000 | 0.01 |
| USD | 100,000 | HALCON RESOURCES 9.75% 15/07/20 | 75,220 | 29,000 | 0.01 |
| USD | 160,000 | BREITBURN ENER 7.875% 15/04/22 | 165,600 | 28,800 | 0.01 |
| USD | 25,000 | MGM MIRAGE 11.375% 01/03/18 | 30,438 | 28,750 | 0.01 |
| USD | 25,000 | MGM RESORTS INTL 8.625% 01/02/19 | 28,438 | 27,750 | 0.01 |
| USD | 25,000 | GREIF INC 7.75% 01/08/19 | 28,625 | 27,625 | 0.01 |
| USD | 37,000 | SM ENERGY CO 6.5% 15/11/21 | 35,058 | 27,565 | 0.01 |
| USD | 100,000 | ENERGY XXI GULF 9.25% 15/12/17 | 100,250 | 27,000 | 0.01 |
| USD | 25,000 | CVS HEALTH CORP 5% 01/12/24 144A | 25,000 | 26,990 | 0.01 |
| USD | 40,000 | PUERTO RICO CMWLTH 6% 01/07/44 | 29,600 | 26,950 | 0.01 |
| USD | 25,000 | CARROLS REST GRP 8% 01/05/22 | 25,000 | 26,375 | 0.01 |
| USD | 25,000 | YUM BRANDS INC 6.25% 15/03/18 | 27,000 | 26,327 | 0.01 |
| USD | 25,000 | ADT CORP 6.25% 15/10/21 | 25,438 | 26,250 | 0.01 |
| USD | 25,000 | NCI BUILDING SYS 8.25% 15/01/23 144 | 25,000 | 26,250 | 0.01 |
| USD | 25,000 | SCOTTS MIRACLE 6% 15/10/23 144A | 25,000 | 26,063 | 0.01 |
| USD | 25,000 | MANITOWOC CO INC 5.875% 15/10/22 | 25,469 | 25,938 | 0.01 |
| USD | 25,000 | NPC INTL/OPER CO 10.5% 15/01/20 | 26,250 | 25,875 | 0.01 |
| USD | 25,000 | ASBURY AUTO 6% 15/12/24 144A | 26,063 | 25,875 | 0.01 |
| USD | 25,000 | CIT GROUP INC 5% 15/05/17 | 25,781 | 25,750 | 0.01 |
| USD | 25,000 | SHEA HOMES LP 5.875% 01/04/23 144A | 25,000 | 25,688 | 0.01 |
| USD | 25,000 | SHEA HOMES LP 6.125% 01/04/25 144A | 25,000 | 25,688 | 0.01 |
| USD | 25,000 | OUTFRONT MEDIA 5.625% 15/02/24 144A | 25,938 | 25,656 | 0.01 |
| USD | 25,000 | BK OF AMERICA CORP 4% 01/04/24 | 25,831 | 25,520 | 0.01 |
| USD | 25,000 | QORVO INC 6.75% 01/12/23 144A | 25,000 | 25,500 | 0.01 |
| USD | 25,000 | CVS HEALTH CORP 3.875% 20/07/25 | 25,561 | 25,442 | 0.01 |
| USD | 25,000 | CONSTELLATION BRAND 4.75% 01/12/25 | 25,000 | 25,406 | 0.01 |
| USD | 25,000 | ARAMARK SERV INC 5.125% 15/01/24 14 | 25,000 | 25,375 | 0.01 |
| USD | 25,000 | MPG HOLDCO I 7.375% 15/10/22 | 25,000 | 25,188 | 0.01 |
| USD | 25,000 | GANNETT CO 4.875% 15/09/21 144A | 24,633 | 25,063 | 0.01 |
| USD | 25,000 | VALEANT PHARMACEUT 7% 01/10/20 144A | 23,313 | 25,063 | 0.01 |
| USD | 25,000 | MICROSOFT CORP 3.125% 03/11/25 | 24,994 | 25,053 | 0.01 |
| USD | 50,000 | EP ENERGY/EVER 6.375% 15/06/23 | 50,292 | 25,000 | 0.01 |
| USD | 25,000 | ANIXTER INC 5.125% 01/10/21 | 25,000 | 25,000 | 0.01 |
| USD | 25,000 | FLEXI VAN LSG 7.875% 15/08/18 144A | 25,438 | 25,000 | 0.01 |
| USD | 25,000 | CELGENE CORP 5% 15/08/45 | 24,784 | 24,998 | 0.01 |
| USD | 25,000 | LOCKHEED MARTIN 3.55% 15/01/26 10YR | 24,807 | 24,987 | 0.01 |
| USD | 25,000 | LOCKHEED MARTIN 3.1% 15/01/23 | 24,840 | 24,928 | 0.01 |
| USD | 25,000 | HCA INC 5.375% 01/02/25 | 23,625 | 24,781 | 0.01 |
| USD | 25,000 | HRG GROUP 7.75% 15/01/22 | 25,000 | 24,750 | 0.01 |
| USD | 25,000 | PENN NTL GAMING 5.875% 01/11/21 | 24,063 | 24,250 | 0.01 |
| USD | 25,000 | CARDTRONICS INC 5.125% 01/08/22 | 24,563 | 24,125 | 0.01 |
| USD | 25,000 | TESORO LOGISTICS 5.5% 15/10/19 144A | 25,000 | 24,063 | 0.01 |
| USD | 25,000 | COMPASS INV/ONEX 7.75% 15/01/21 144 | 25,031 | 24,000 | 0.01 |
| USD | 25,000 | COMMSCOPE 5.5% 15/06/24 144A | 24,813 | 23,750 | 0.01 |
| USD | 25,000 | JAC HOLDING 11.5% 01/10/19 144A | 25,000 | 23,438 | 0.01 |
| USD | 25,000 | ENERGY TRANSFER EQ 7.5% 15/10/20 | 24,813 | 23,125 | 0.01 |
| USD | 50,000 | COMSTOCK RES 10% 15/03/20 144A | 49,200 | 23,000 | 0.01 |
| USD | 200,000 | MIDSTATES PETRO 9.25% 01/06/21 | 105,944 | 23,000 | 0.01 |
| USD | 25,000 | CENTURY COMM 6.875% 15/05/22 | 24,565 | 22,938 | 0.01 |
| USD | 121,000 | PEABODY ENERGY 10% 15/03/22 144A | 103,953 | 22,688 | 0.01 |
| USD | 25,000 | WALGREENS BOOTS 4.8% 18/11/44 | 25,868 | 22,514 | 0.01 |
| USD | 25,000 | ENDEAVOR ENERGY 8.125% 15/9/23 144A | 25,000 | 22,500 | 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 | CEQUEL COM HLD 5.125% 15/12/21 144A | 24,313 | 22,438 | 0.01 |
| USD | 21,000 | CALPINE CORP 7.875% 15/01/23 144A | 22,785 | 22,418 | 0.01 |
| USD | 25,000 | RRI ENERGY INC 7.875% 15/06/17 | 25,125 | 22,000 | 0.01 |
| USD | 100,000 | GYMBOREE CORP 9.125% 01/12/18 | 47,594 | 22,000 | 0.01 |
| USD | 25,000 | WOODSIDE HOMES CO 6.75% 15/12/21 14 | 24,125 | 21,500 | 0.01 |
| USD | 75,000 | CHESAPEAKE ENERGY 6.875% 15/11/20 | 68,563 | 21,469 | 0.01 |
| USD | 25,000 | APPLE INC 3.45% 09/02/45 | 21,462 | 21,425 | 0.01 |
| USD | 31,000 | OASIS PETROLEUM 6.5% 01/11/21 | 28,404 | 20,538 | 0.01 |
| USD | 50,000 | AK STEEL CORP 7.625% 15/05/20 | 33,500 | 20,125 | 0.01 |
| USD | 25,000 | WINDSTREAM CORP 7.5% 01/06/22 WI | 25,063 | 19,188 | 0.01 |
| USD | 25,000 | AVAYA INC 9% 01/04/19 144A | 20,625 | 18,875 | 0.01 |
| USD | 150,000 | MIDSTATES PETRO 10.75% 01/10/20 | 117,328 | 18,750 | 0.01 |
| USD | 18,000 | FAMILY TREE ESC 5.25% 01/03/20 144A | 18,000 | 18,675 | 0.01 |
| USD | 50,000 | CNG HLDG INC 9.375% 15/05/20 144A | 37,688 | 18,563 | 0.01 |
| USD | 25,000 | GENON ENERGY 9.875% 15/10/20 WI | 26,000 | 18,500 | 0.01 |
| USD | 25,000 | BAKERCORP 8.25% 01/06/19 | 19,313 | 18,375 | 0.01 |
| USD | 67,000 | CHESAPEAKE ENERGY 4.875% 15/04/22 | 53,410 | 18,090 | 0.01 |
| USD | 50,000 | APPROACH RESOURCES 7% 15/06/21 | 45,563 | 17,750 | 0.01 |
| USD | 50,000 | DENBURY RESOURCES 6.375% 15/08/21 | 43,875 | 17,500 | 0.01 |
| USD | 50,000 | ACE CASH EXPRESS 11% 01/02/19 144A | 33,469 | 17,500 | 0.01 |
| USD | 50,000 | ALTA MESA HDGS/FIN 9.625% 15/10/18 | 39,500 | 17,500 | 0.01 |
| USD | 25,000 | CRESTWOOD MID 6.25% 01/04/23 144A | 25,000 | 17,375 | 0.01 |
| USD | 118,000 | PEABODY ENERGY CORP 6.25% 15/11/21 | 111,510 | 15,930 | 0.00 |
| USD | 150,000 | SANDRIDGE ENERGY 8.75% 15/01/20 | 145,500 | 14,625 | 0.00 |
| USD | 50,000 | HALCON RESOURCES 8.875% 15/05/21 | 39,471 | 14,500 | 0.00 |
| USD | 150,000 | SANDRIDGE ENERGY 8.125% 15/10/22 | 134,083 | 14,250 | 0.00 |
| USD | 25,000 | MIDSTATES PETRO 10% 01/06/20 | 18,563 | 10,875 | 0.00 |
| USD | 100,000 | SANDRIDGE ENERGY 7.5% 15/03/21 | 70,214 | 10,500 | 0.00 |
| USD | 50,000 | EXCO RESOURCES INC 8.5% 15/04/22 | 29,938 | 9,000 | 0.00 |
| USD | 10,000 | IHEART COMMUNICATIONS 9% 01/03/21 | 8,850 | 6,900 | 0.00 |
| USD | 10,000 | PUERTO RICO AQUE&SE 5.125% 01/07/37 | 7,125 | 6,475 | 0.00 |
| USD | 25,000 | CHAPARRAL ENERGY 9.875% 01/10/20 | 20,875 | 6,250 | 0.00 |
| USD | 25,000 | CLAIRE'S ST ESC 8.875% 15/3/19 | 15,594 | 5,750 | 0.00 |
| USD | 25,000 | CHAPARRAL ENERGY 8.25% 01/09/21 | 5,375 | 5,750 | 0.00 |
| USD | 25,000 | SEVENTY SEVEN ENER 6.5% 15/7/22 | 15,188 | 3,938 | 0.00 |
| USD | 25,000 | ENERGY XXI GULF 7.5% 15/12/21 | 11,000 | 2,750 | 0.00 |
| USD | 75,000 | ARCH COAL INC 8% 15/01/19 144A | 51,375 | 2,625 | 0.00 |
| USD | 25,000 | SABINE OIL & GAS CORP 7.25% 15/6/19 | 6,500 | 1,625 | 0.00 |
| USD | 25,000 | SABINE OIL GAS CORP 9.75% 15/02/17 | 11,875 | 1,250 | 0.00 |
| | | | 114,797,421 | 102,375,537 | 30.09 |
| TBA取引 | | | | | |
| USD | 2,435,000 | FNCL 30YR TBA 4% 13/01/16 REG A | 2,580,719 | 2,570,446 | 0.76 |
| USD | 1,775,000 | FNCL 30YR TBA 4.5% 13/01/16 | 1,916,456 | 1,913,671 | 0.56 |
| USD | 1,450,000 | FGLMC 30YR TBA 4% 13/01/16 REG A | 1,534,142 | 1,528,391 | 0.45 |
| USD | 615,000 | G2SF 30YR TBA 4% 21/01/16 REG C | 653,347 | 651,708 | 0.19 |
| USD | 525,000 | FNCL 15YR TBA 3% 19/01/16 REG B | 541,639 | 539,930 | 0.16 |
| USD | 405,000 | FNCL 30YR TBA 3.5% 13/01/16 REG A | 418,797 | 416,517 | 0.12 |
| USD | 390,000 | FNCL 15YR TBA 3.5% 19/01/16 REG B | 409,182 | 407,794 | 0.12 |
| USD | 290,000 | FGLMC 30YR TBA 3.5% 13/01/16 REG A | 299,244 | 297,613 | 0.09 |
| USD | 205,000 | FGLMC 30YR TBA 4.5% 13/01/16 REG A | 220,984 | 220,503 | 0.06 |
| USD | 205,000 | G2SF 30YR TBA 3.5% 21/01/16 REG C | 213,969 | 213,136 | 0.06 |
| | | | 8,788,479 | 8,759,709 | 2.57 |
| 優先証券 | | | | | |
| -- | 17,358 | GMAC CAP TST I PFD FRN 15/02/40 | 458,368 | 440,546 | 0.12 |
| -- | 772 | ALLY FINANCIAL PFD FRN 31/12/49 | 20,419 | 19,864 | 0.01 |
| -- | 733 | COWEN GROUP PFD 8.25% 15/10/21 | 18,325 | 18,693 | 0.01 |
| | | | 497,112 | 479,103 | 0.14 |

| 通貨 | 数量/ 額面価格 ⁽¹⁾ | 銘柄名 | 取得時価 | 評価金額 | 組入比率 (%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------|
| 国債 | | | | | |
| USD | 1,600,000 | US TREAS NOTE 1.75% 31/12/20 | 1,597,333 | 1,595,251 | 0.47 |
| USD | 1,400,000 | US TREAS NOTE 3.625% 15/08/43 | 1,609,817 | 1,566,906 | 0.46 |
| USD | 715,000 | US TREAS NOTE 3.875% 15/04/29 (CPI) | 1,503,860 | 1,400,241 | 0.41 |
| USD | 1,000,000 | US TREAS NOTE 3% 15/11/45 | 1,004,804 | 990,000 | 0.29 |
| USD | 700,000 | US TREAS NOTE 0.125% 15/04/17 (CPI) | 732,401 | 730,385 | 0.21 |
| USD | 650,000 | US TREAS NOTE 0.375% 15/07/23 (CPI) | 666,892 | 646,310 | 0.19 |
| USD | 500,000 | US TREAS NOTE 3.75% 15/11/43 | 592,091 | 572,109 | 0.17 |
| USD | 400,000 | US TREAS NOTE 0.125% 15/04/18 (CPI) | 411,673 | 410,089 | 0.12 |
| USD | 300,000 | US TREAS NOTE 0.125% 15/01/22 (CPI) | 310,102 | 304,517 | 0.09 |
| USD | 240,000 | US TREAS NOTE 0.75% 15/02/42 CPI | 222,886 | 219,879 | 0.06 |
| USD | 110,000 | US TREAS NOTE 2.125% 15/02/40 (CPI) | 148,020 | 141,529 | 0.04 |
| USD | 90,000 | US TREAS NOTE 2.75% 15/02/24 | 94,068 | 93,473 | 0.03 |
| USD | 50,000 | US TREAS NOTE 1.375% 15/02/44 (CPI) | 56,433 | 51,446 | 0.02 |
| USD | 30,000 | US TREAS NOTE 2% 15/01/26 (CPI) | 42,462 | 39,796 | 0.01 |
| USD | 15,000 | US TREAS NOTE 4.5% 15/02/36 | 19,577 | 19,144 | 0.01 |
| | | | <u>9,012,419</u> | <u>8,781,075</u> | <u>2.58</u> |
| | 合計: アメリカ | | <u>279,219,998</u> | <u>258,598,225</u> | <u>76.01</u> |
| ベネズエラ | | | | | |
| 国債 | | | | | |
| USD | 190,000 | BOL REP OF VZLA 8.25% 13/10/24 REGS | 72,107 | 73,150 | 0.01 |
| USD | 110,000 | REP OF VENEZUELA 9.25% 7/5/28 | 49,238 | 43,450 | 0.01 |
| USD | 80,000 | REP OF VENEZUELA 9% 07/05/23 | 34,815 | 32,200 | 0.01 |
| USD | 50,000 | REP OF VENEZUELA 7.75% 13/10/19 REG | 20,693 | 20,125 | 0.01 |
| USD | 50,000 | REP OF VENEZUELA 6% 09/12/20 REGS | 19,725 | 18,875 | 0.01 |
| USD | 40,000 | REP OF VENEZUELA 11.75% 21/10/26 | 16,900 | 18,000 | 0.01 |
| USD | 20,000 | REP OF VENEZUELA 7.65% 21/04/25 | 7,489 | 7,500 | 0.00 |
| USD | 10,000 | REP OF VENEZUELA 9.25% 15/09/27 | 4,150 | 4,150 | 0.00 |
| USD | 10,000 | REP OF VENEZUELA 9.375% 13/01/34 | 3,400 | 3,965 | 0.00 |
| | | | <u>228,517</u> | <u>221,415</u> | <u>0.06</u> |
| その他債券 | | | | | |
| USD | 180,000 | PETROLEOS VENEZ 6% 16/05/24 REGS | 70,202 | 68,040 | 0.02 |
| USD | 140,000 | PETROLEOS VENEZU 6% 15/11/26 REGS | 53,162 | 52,325 | 0.02 |
| USD | 50,000 | REP OF VENEZUELA 11.95% 5/8/31 | 21,053 | 22,375 | 0.01 |
| USD | 40,000 | PETROLEOS VENEZU 9% 17/11/21 REGS | 16,160 | 16,112 | 0.00 |
| USD | 10,000 | BOL REP OF VZLA 12.75% 23/08/22 | 4,659 | 4,600 | 0.00 |
| | | | <u>165,236</u> | <u>163,452</u> | <u>0.05</u> |
| 普通社債(固定金利債) | | | | | |
| USD | 50,000 | PETROLEOS VENEZUELA 5.375% 12/04/27 | 18,950 | 18,375 | 0.01 |
| USD | 10,000 | PETROLEOS DE VEN 5.5% 12/04/37 | 4,475 | 3,625 | 0.00 |
| | | | <u>23,425</u> | <u>22,000</u> | <u>0.01</u> |
| | 合計: ベネズエラ | | <u>417,178</u> | <u>406,867</u> | <u>0.12</u> |
| 組入資産合計 | | | <u>352,690,789</u> | <u>325,823,082</u> | <u>95.75</u> |

(1) 額面価格は発行通貨建てで表示

財務書類に関する注記

2015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

2015年12月31日現在、ファンドは以下の未決済外国為替先渡し契約を有していた。外国為替先渡し契約は投資目的とヘッジ目的で用いられた。

| 購入通貨 | 購入金額 | 売却通貨 | 売却金額 | 満期日 | 未実現損益 (米ドル) |
|------|---------------|------|-------------|------------|----------------|
| JPY | 689,612,909 | USD | 5,592,164 | 2016年1月14日 | 135,603 |
| JPY | 689,539,138 | USD | 5,665,296 | 2016年1月25日 | 63,312 |
| JPY | 5,917,124 | USD | 48,433 | 2016年1月25日 | 725 |
| JPY | 5,918,311 | USD | 48,433 | 2016年1月14日 | 722 |
| JPY | 6,021,408 | USD | 49,826 | 2016年1月25日 | 199 |
| JPY | 6,022,629 | USD | 49,826 | 2016年1月14日 | 196 |
| TRY | 36,000,000 | USD | 12,110,284 | 2016年1月22日 | 182,965 |
| INR | 1,658,000,000 | USD | 24,613,648 | 2016年2月18日 | 130,858 |
| INR | 992,000,000 | USD | 14,770,696 | 2016年1月22日 | 100,553 |
| USD | 1,924,950 | MXN | 32,000,000 | 2016年1月22日 | 76,467 |
| USD | 922,107 | ZAR | 13,100,000 | 2016年1月22日 | 74,038 |
| BRL | 102,100,000 | USD | 26,055,556 | 2016年2月2日 | 64,850 |
| USD | 1,523,869 | BRL | 5,800,000 | 2016年1月5日 | 26,856 |
| USD | 1,125,061 | ZAR | 17,000,000 | 2016年1月22日 | 24,513 |
| BRL | 9,200,000 | USD | 2,358,792 | 2016年1月5日 | 15,780 |
| USD | 1,357,702 | BRL | 5,200,000 | 2016年1月5日 | 15,552 |
| USD | 968,288 | TRY | 2,800,000 | 2016年1月22日 | 12,147 |
| USD | 1,398,052 | MXN | 24,000,000 | 2016年1月22日 | 11,689 |
| USD | 1,638,678 | INR | 109,000,000 | 2016年1月22日 | 4,640 |
| USD | 683,223 | TRY | 2,000,000 | 2016年1月22日 | 265 |
| USD | 809,316 | INR | 54,000,000 | 2016年1月22日 | (208) |
| USD | 1,165,745 | INR | 78,000,000 | 2016年1月22日 | (3,567) |
| USD | 1,259,617 | TRY | 3,700,000 | 2016年1月22日 | (3,855) |
| USD | 760,470 | INR | 51,000,000 | 2016年1月22日 | (4,080) |
| USD | 1,239,916 | INR | 83,000,000 | 2016年1月22日 | (4,352) |
| USD | 1,461,881 | TRY | 4,300,000 | 2016年1月22日 | (6,478) |
| TRY | 48,100,000 | USD | 16,303,841 | 2016年2月19日 | (9,585) |
| USD | 1,661,844 | INR | 112,000,000 | 2016年1月22日 | (17,168) |
| USD | 824,072 | BRL | 3,300,000 | 2016年2月2日 | (20,171) |
| USD | 1,260,874 | TRY | 3,800,000 | 2016年1月22日 | (36,747) |
| USD | 26,314,432 | BRL | 102,100,000 | 2016年1月5日 | (38,169) |
| ZAR | 9,700,000 | USD | 669,116 | 2016年1月22日 | (41,156) |
| ZAR | 11,300,000 | USD | 781,607 | 2016年1月22日 | (50,066) |
| ZAR | 32,800,000 | USD | 2,257,898 | 2016年1月22日 | (134,486) |
| BRL | 103,900,000 | USD | 26,977,133 | 2016年1月5日 | (159,940) |
| MXN | 194,500,000 | USD | 11,512,486 | 2016年1月22日 | (277,170) |
| MXN | 444,000,000 | USD | 26,244,547 | 2016年2月19日 | (647,058) |
| ZAR | 150,800,000 | USD | 10,431,221 | 2016年1月22日 | (668,704) |
| ZAR | 185,700,000 | USD | 12,708,819 | 2016年2月19日 | (748,555) |
| USD | 18,370 | JPY | 2,212,797 | 2016年1月14日 | (9) |
| USD | 18,617 | JPY | 2,242,584 | 2016年1月14日 | (9) |
| USD | 18,370 | JPY | 2,212,319 | 2016年1月25日 | (9) |
| USD | 18,617 | JPY | 2,242,100 | 2016年1月25日 | (9) |
| USD | 12,666 | JPY | 1,543,348 | 2016年1月14日 | (153) |
| USD | 12,666 | JPY | 1,543,050 | 2016年1月25日 | (153) |
| USD | 89,895 | JPY | 10,867,554 | 2016年1月14日 | (368) |
| USD | 89,895 | JPY | 10,865,127 | 2016年1月25日 | (371) |
| USD | 136,128 | JPY | 16,587,248 | 2016年1月14日 | (1,641) |

| 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 | 136,128 | JPY | 16,584,049 | 2016年1月25日 | (1,649) |
| USD | 2,643,386 | CAD | 3,500,000 | 2016年1月14日 | 117,099 |
| BRL | 9,060,000 | USD | 2,260,238 | 2016年2月2日 | 57,596 |
| AUD | 3,400,000 | USD | 2,420,521 | 2016年1月14日 | 57,566 |
| NZD | 2,290,633 | AUD | 2,100,000 | 2016年1月14日 | 40,896 |
| JPY | 180,000,000 | USD | 1,466,501 | 2016年1月14日 | 28,538 |
| USD | 1,852,428 | KRW | 2,140,000,000 | 2016年1月14日 | 28,367 |
| USD | 1,193,722 | GBP | 788,721 | 2016年1月13日 | 25,125 |
| PLN | 2,246,874 | USD | 556,659 | 2016年3月16日 | 22,032 |
| MYR | 5,500,000 | USD | 1,259,971 | 2016年1月14日 | 20,998 |
| USD | 577,899 | MXN | 9,684,329 | 2016年1月21日 | 18,455 |
| JPY | 152,667,375 | USD | 1,250,000 | 2016年1月14日 | 18,021 |
| USD | 1,464,507 | KRW | 1,700,000,000 | 2016年1月14日 | 15,486 |
| EUR | 400,000 | USD | 424,676 | 2016年1月14日 | 12,967 |
| USD | 599,078 | GBP | 396,618 | 2016年1月13日 | 11,435 |
| USD | 389,854 | MXN | 6,577,204 | 2016年2月18日 | 10,639 |
| USD | 1,289,566 | MYR | 5,500,000 | 2016年1月14日 | 9,497 |
| USD | 1,377,436 | EUR | 1,248,982 | 2016年3月16日 | 8,756 |
| AUD | 800,000 | USD | 574,496 | 2016年1月14日 | 8,583 |
| HUF | 147,000,000 | USD | 505,212 | 2016年1月14日 | 8,008 |
| USD | 202,896 | MXN | 3,386,238 | 2016年3月3日 | 7,853 |
| USD | 600,000 | TWD | 19,480,680 | 2016年1月14日 | 7,599 |
| USD | 213,000 | RUB | 15,169,817 | 2016年1月19日 | 6,364 |
| USD | 140,000 | CNH | 903,700 | 2016年9月1日 | 6,040 |
| USD | 332,339 | MXN | 5,668,478 | 2016年3月10日 | 5,994 |
| USD | 141,509 | CAD | 188,000 | 2016年1月7日 | 5,815 |
| EUR | 115,748 | GBP | 81,764 | 2016年3月16日 | 5,689 |
| INR | 140,000,000 | USD | 2,096,122 | 2016年1月14日 | 5,595 |
| USD | 140,000 | CNH | 907,200 | 2016年9月1日 | 5,521 |
| USD | 231,000 | CNH | 1,523,882 | 2016年9月1日 | 5,108 |
| USD | 350,926 | CNH | 2,337,168 | 2016年9月1日 | 4,477 |
| USD | 326,834 | CNH | 2,176,064 | 2016年9月1日 | 4,266 |
| BRL | 544,998 | USD | 136,420 | 2016年1月5日 | 4,247 |
| USD | 444,730 | MXN | 7,655,008 | 2016年3月17日 | 4,230 |
| USD | 126,563 | KRW | 143,582,573 | 2016年1月15日 | 4,182 |
| USD | 126,498 | KRW | 143,549,686 | 2016年1月15日 | 4,145 |
| USD | 154,000 | CNH | 1,010,990 | 2016年9月1日 | 4,136 |
| USD | 154,000 | CNH | 1,012,515 | 2016年9月1日 | 3,910 |
| SEK | 2,244,405 | EUR | 242,595 | 2016年3月16日 | 3,468 |
| SEK | 2,243,452 | EUR | 242,669 | 2016年3月16日 | 3,273 |
| USD | 71,000 | RUB | 4,981,061 | 2016年1月14日 | 3,054 |
| USD | 70,000 | CNH | 451,692 | 2016年9月1日 | 3,043 |
| HUF | 31,567,773 | USD | 107,191 | 2016年3月16日 | 2,953 |
| SEK | 1,151,710 | EUR | 123,513 | 2016年3月16日 | 2,846 |
| USD | 60,035 | MXN | 992,568 | 2016年1月28日 | 2,721 |
| HUF | 30,592,471 | USD | 104,148 | 2016年3月16日 | 2,593 |
| SEK | 1,208,698 | EUR | 130,000 | 2016年3月16日 | 2,577 |
| AUD | 920,000 | JPY | 80,426,400 | 2016年1月14日 | 2,538 |
| USD | 119,565 | GBP | 79,000 | 2016年1月13日 | 2,517 |
| NZD | 109,239 | USD | 72,459 | 2016年1月22日 | 2,445 |
| SEK | 1,486,273 | EUR | 160,518 | 2016年3月16日 | 2,440 |
| COP | 141,077,765 | USD | 42,056 | 2016年1月27日 | 2,366 |
| JPY | 17,350,625 | USD | 142,000 | 2016年3月16日 | 2,352 |
| PHP | 13,000,000 | USD | 274,261 | 2016年1月14日 | 2,341 |
| SEK | 1,195,042 | EUR | 128,734 | 2016年3月16日 | 2,325 |
| AUD | 880,000 | JPY | 76,956,000 | 2016年1月14日 | 2,208 |
| USD | 216,162 | KRW | 251,156,500 | 2016年1月14日 | 2,085 |
| EUR | 270,279 | USD | 294,119 | 2016年3月16日 | 2,063 |
| USD | 207,000 | CNH | 1,362,577 | 2016年3月16日 | 2,046 |
| SEK | 1,194,851 | EUR | 128,993 | 2016年3月16日 | 2,018 |
| TRY | 217,114 | USD | 71,000 | 2016年3月16日 | 2,007 |

| 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 | 67,000 | BRL | 252,027 | 2016年1月5日 | 1,950 |
| USD | 165,794 | KRW | 192,264,935 | 2016年1月15日 | 1,919 |
| SEK | 1,260,690 | USD | 149,410 | 2016年3月16日 | 1,863 |
| AUD | 100,000 | USD | 70,808 | 2016年3月16日 | 1,854 |
| USD | 76,000 | CNH | 500,210 | 2016年9月1日 | 1,851 |
| USD | 67,000 | BRL | 252,442 | 2016年1月5日 | 1,843 |
| USD | 69,000 | CAD | 93,033 | 2016年3月16日 | 1,834 |
| USD | 78,520 | CAD | 106,469 | 2016年3月16日 | 1,655 |
| JPY | 8,490,270 | USD | 69,000 | 2016年3月16日 | 1,637 |
| SEK | 1,140,244 | EUR | 123,562 | 2016年3月16日 | 1,417 |
| AUD | 191,000 | USD | 137,483 | 2016年3月16日 | 1,301 |
| SEK | 482,466 | EUR | 51,702 | 2016年3月16日 | 1,236 |
| PLN | 286,094 | EUR | 66,118 | 2016年3月16日 | 1,230 |
| USD | 69,000 | CNH | 450,549 | 2016年3月16日 | 1,230 |
| USD | 124,653 | TWD | 4,059,964 | 2016年1月29日 | 1,185 |
| USD | 155,164 | CNH | 1,023,803 | 2016年3月16日 | 1,167 |
| USD | 71,000 | MXN | 1,214,632 | 2016年3月16日 | 1,101 |
| SEK | 584,097 | EUR | 62,967 | 2016年3月16日 | 1,085 |
| SEK | 602,639 | EUR | 65,000 | 2016年3月16日 | 1,083 |
| BRL | 523,203 | USD | 134,000 | 2016年1月5日 | 1,042 |
| USD | 367,791 | EUR | 335,000 | 2016年2月10日 | 1,023 |
| USD | 67,000 | BRL | 255,662 | 2016年1月5日 | 1,012 |
| USD | 74,135 | TWD | 2,405,022 | 2016年1月8日 | 1,002 |
| COP | 91,456,200 | USD | 27,849 | 2016年1月12日 | 994 |
| SEK | 583,343 | EUR | 63,000 | 2016年3月16日 | 959 |
| SEK | 417,075 | USD | 49,105 | 2016年3月16日 | 941 |
| USD | 77,000 | CNH | 513,112 | 2016年9月1日 | 939 |
| KRW | 84,383,500 | USD | 71,000 | 2016年1月15日 | 924 |
| KRW | 84,362,200 | USD | 71,000 | 2016年1月15日 | 906 |
| USD | 159,751 | TWD | 5,225,461 | 2016年2月4日 | 828 |
| USD | 82,306 | GBP | 55,000 | 2016年1月13日 | 817 |
| USD | 71,000 | MXN | 1,220,000 | 2016年3月16日 | 792 |
| USD | 62,000 | TWD | 2,013,450 | 2016年1月8日 | 774 |
| SEK | 401,538 | EUR | 43,299 | 2016年3月16日 | 732 |
| SEK | 445,301 | USD | 52,727 | 2016年3月16日 | 705 |
| USD | 69,000 | CNH | 454,192 | 2016年3月16日 | 682 |
| USD | 83,635 | ILS | 322,591 | 2016年3月16日 | 679 |
| PLN | 270,683 | EUR | 63,000 | 2016年3月16日 | 678 |
| USD | 219,344 | SGD | 309,834 | 2016年3月16日 | 661 |
| SEK | 310,734 | EUR | 33,440 | 2016年3月16日 | 641 |
| USD | 82,420 | CLP | 57,997,822 | 2016年1月11日 | 632 |
| USD | 70,000 | CNH | 461,384 | 2016年3月16日 | 600 |
| KRW | 81,620,100 | USD | 69,000 | 2016年1月8日 | 582 |
| USD | 115,649 | TWD | 3,785,554 | 2016年1月21日 | 529 |
| HUF | 30,641,123 | USD | 106,398 | 2016年3月16日 | 513 |
| CLP | 45,351,086 | USD | 63,401 | 2016年1月12日 | 505 |
| KRW | 82,690,650 | USD | 70,000 | 2016年1月14日 | 483 |
| USD | 70,000 | ZAR | 1,084,813 | 2016年3月16日 | 473 |
| USD | 154,576 | TWD | 5,069,964 | 2016年1月19日 | 398 |
| USD | 69,000 | BRL | 265,808 | 2016年1月5日 | 393 |
| COP | 280,459,322 | USD | 88,042 | 2016年1月15日 | 379 |
| USD | 29,767 | MXN | 510,000 | 2016年2月5日 | 335 |
| JPY | 79,015,500 | AUD | 900,000 | 2016年1月14日 | 320 |
| JPY | 79,015,500 | AUD | 900,000 | 2016年1月14日 | 320 |
| USD | 135,361 | AUD | 186,000 | 2016年3月16日 | 210 |
| USD | 57,532 | IDR | 794,636,077 | 2016年1月19日 | 161 |
| USD | 218,840 | SGD | 309,845 | 2016年3月16日 | 150 |
| USD | 142,000 | JPY | 17,057,167 | 2016年3月16日 | 89 |
| USD | 86,724 | CLP | 61,496,724 | 2016年1月15日 | 61 |
| USD | 136,536 | KRW | 160,157,250 | 2016年1月22日 | 55 |
| USD | 55,000 | CLP | 39,007,155 | 2016年1月12日 | 33 |

| 購入通貨 | 購入金額 | 売却通貨 | 売却金額 | 満期日 | 未実現損益 (米ドル) |
|------|---------------|------|-------------|------------|----------------|
| CLP | 19,938,036 | USD | 28,020 | 2016年1月27日 | 20 |
| EUR | 30,489 | USD | 33,402 | 2016年3月16日 | 10 |
| USD | 42,174 | TWD | 1,387,600 | 2016年2月4日 | (27) |
| GBP | 48,053 | EUR | 65,000 | 2016年3月16日 | (28) |
| USD | 3,826,283 | ILS | 14,900,000 | 2016年1月14日 | (43) |
| KRW | 166,566,000 | USD | 142,000 | 2016年1月19日 | (45) |
| EUR | 46,000 | HUF | 14,472,152 | 2016年3月16日 | (87) |
| USD | 66,232 | MYR | 284,844 | 2016年1月8日 | (91) |
| USD | 48,932 | AED | 180,661 | 2016年12月7日 | (101) |
| USD | 25,819 | CLP | 18,425,000 | 2016年1月15日 | (146) |
| USD | 68,137 | AUD | 94,000 | 2016年3月16日 | (165) |
| USD | 65,145 | AED | 240,655 | 2016年12月7日 | (171) |
| USD | 24,525 | EUR | 22,587 | 2016年2月10日 | (204) |
| CNH | 317,616 | USD | 48,000 | 2016年3月16日 | (225) |
| KRW | 80,681,010 | USD | 69,000 | 2016年1月14日 | (230) |
| USD | 71,598 | IDR | 993,077,400 | 2016年1月11日 | (237) |
| AUD | 99,981 | USD | 73,084 | 2016年1月22日 | (243) |
| USD | 71,000 | TWD | 2,342,780 | 2016年1月21日 | (245) |
| USD | 69,000 | TWD | 2,277,690 | 2016年1月11日 | (261) |
| USD | 68,000 | BRL | 264,656 | 2016年1月5日 | (309) |
| CNH | 469,944 | USD | 71,000 | 2016年3月16日 | (313) |
| USD | 130,291 | AED | 481,245 | 2016年12月7日 | (324) |
| USD | 130,291 | AED | 481,245 | 2016年12月7日 | (324) |
| USD | 266,000 | AED | 979,970 | 2016年8月11日 | (325) |
| MXN | 1,228,025 | USD | 71,000 | 2016年3月16日 | (330) |
| USD | 129,824 | AED | 479,622 | 2016年12月7日 | (351) |
| USD | 71,000 | CAD | 98,864 | 2016年3月16日 | (375) |
| TWD | 2,190,364 | USD | 67,000 | 2016年1月8日 | (395) |
| USD | 71,867 | EUR | 65,952 | 2016年3月16日 | (405) |
| CNH | 469,089 | USD | 71,000 | 2016年3月16日 | (441) |
| CNH | 462,309 | USD | 70,000 | 2016年3月16日 | (461) |
| USD | 70,931 | IDR | 989,135,400 | 2016年1月19日 | (483) |
| USD | 304,000 | AED | 1,120,422 | 2016年8月11日 | (496) |
| COP | 253,489,196 | USD | 80,447 | 2016年1月12日 | (504) |
| USD | 71,000 | BRL | 277,644 | 2016年1月5日 | (662) |
| MXN | 1,221,576 | USD | 71,000 | 2016年3月16日 | (701) |
| CAD | 165,779 | EUR | 109,893 | 2016年3月16日 | (741) |
| USD | 225,178 | KRW | 265,097,673 | 2016年1月8日 | (821) |
| IDR | 7,900,000,000 | USD | 571,925 | 2016年1月14日 | (852) |
| CNH | 452,817 | USD | 69,000 | 2016年3月16日 | (889) |
| KRW | 158,442,720 | USD | 136,000 | 2016年1月15日 | (952) |
| MXN | 1,182,335 | USD | 69,000 | 2016年3月16日 | (959) |
| CNH | 1,402,975 | USD | 212,000 | 2016年3月16日 | (969) |
| CNH | 452,191 | USD | 69,000 | 2016年3月16日 | (983) |
| USD | 68,755 | AUD | 96,000 | 2016年3月16日 | (1,000) |
| USD | 93,752 | KRW | 111,190,906 | 2016年1月14日 | (1,022) |
| MXN | 1,180,387 | USD | 69,000 | 2016年3月16日 | (1,071) |
| EUR | 66,000 | PLN | 285,087 | 2016年3月16日 | (1,100) |
| USD | 68,260 | IDR | 958,372,586 | 2016年1月8日 | (1,113) |
| BRL | 255,203 | USD | 67,000 | 2016年1月5日 | (1,131) |
| USD | 69,807 | NZD | 104,000 | 2016年3月16日 | (1,269) |
| CNH | 443,130 | USD | 67,000 | 2016年9月1日 | (1,313) |
| USD | 69,000 | JPY | 8,452,293 | 2016年3月16日 | (1,321) |
| USD | 69,306 | IDR | 978,950,000 | 2016年1月22日 | (1,324) |
| USD | 69,721 | NZD | 104,000 | 2016年3月16日 | (1,355) |
| EUR | 109,771 | AUD | 167,414 | 2016年3月16日 | (1,355) |
| USD | 142,000 | CAD | 198,620 | 2016年3月16日 | (1,394) |
| ZAR | 1,069,453 | USD | 70,000 | 2016年3月16日 | (1,458) |
| USD | 132,496 | JPY | 16,101,377 | 2016年3月16日 | (1,463) |
| USD | 71,004 | AUD | 99,750 | 2016年3月16日 | (1,476) |
| MXN | 1,172,915 | USD | 69,000 | 2016年3月16日 | (1,501) |

| 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 | 265,306 | USD | 70,000 | 2016年1月5日 | (1,523) |
| CAD | 99,969 | USD | 73,754 | 2016年3月16日 | (1,581) |
| RUB | 4,453,580 | USD | 62,253 | 2016年1月19日 | (1,589) |
| USD | 70,538 | BRL | 279,876 | 2016年1月5日 | (1,699) |
| USD | 225,973 | TRY | 677,334 | 2016年3月16日 | (1,787) |
| EUR | 64,000 | PLN | 279,488 | 2016年3月16日 | (1,850) |
| USD | 142,000 | JPY | 17,291,198 | 2016年3月16日 | (1,858) |
| EUR | 109,771 | AUD | 168,183 | 2016年3月16日 | (1,914) |
| CLP | 161,388,103 | USD | 229,456 | 2016年1月13日 | (2,032) |
| BRL | 259,405 | USD | 69,000 | 2016年1月5日 | (2,046) |
| USD | 210,092 | AUD | 292,000 | 2016年3月16日 | (2,080) |
| USD | 65,198 | IDR | 940,168,000 | 2016年2月17日 | (2,213) |
| RUB | 4,538,149 | USD | 64,077 | 2016年1月19日 | (2,261) |
| RUB | 5,057,117 | USD | 71,000 | 2016年1月28日 | (2,290) |
| CLP | 508,960,000 | USD | 718,089 | 2016年2月4日 | (2,715) |
| RUB | 5,912,133 | USD | 83,027 | 2016年2月3日 | (2,828) |
| RUB | 4,316,551 | USD | 61,264 | 2016年2月11日 | (2,832) |
| USD | 94,288 | IDR | 1,355,394,589 | 2016年2月19日 | (2,856) |
| USD | 79,796 | SEK | 691,606 | 2016年1月15日 | (3,046) |
| USD | 135,932 | JPY | 16,719,499 | 2016年3月16日 | (3,168) |
| USD | 59,067 | COP | 197,725,325 | 2016年1月21日 | (3,230) |
| USD | 71,000 | COP | 235,951,318 | 2016年1月19日 | (3,358) |
| RUB | 4,814,768 | USD | 69,000 | 2016年1月21日 | (3,453) |
| GBP | 181,000 | USD | 271,852 | 2016年1月13日 | (3,676) |
| CAD | 385,378 | USD | 282,000 | 2016年3月16日 | (3,777) |
| GBP | 133,259 | USD | 201,279 | 2016年1月13日 | (3,837) |
| COP | 366,076,963 | USD | 119,613 | 2016年1月27日 | (4,344) |
| USD | 142,000 | BRL | 572,061 | 2016年2月2日 | (4,351) |
| USD | 135,047 | BRL | 544,998 | 2016年2月2日 | (4,380) |
| MXN | 4,568,367 | USD | 267,398 | 2016年3月16日 | (4,499) |
| CAD | 279,072 | EUR | 188,686 | 2016年3月16日 | (5,293) |
| RUB | 10,036,397 | USD | 142,058 | 2016年1月19日 | (5,347) |
| USD | 159,104 | NZD | 240,902 | 2016年3月16日 | (5,536) |
| CHF | 1,078,304 | EUR | 1,000,000 | 2016年1月14日 | (5,850) |
| RUB | 4,585,217 | USD | 68,646 | 2016年1月14日 | (6,100) |
| USD | 564,689 | IDR | 7,900,000,000 | 2016年1月14日 | (6,384) |
| MXN | 4,679,882 | USD | 276,294 | 2016年3月16日 | (6,978) |
| CAD | 233,171 | USD | 175,510 | 2016年1月7日 | (7,212) |
| USD | 211,399 | EUR | 200,000 | 2016年1月14日 | (7,422) |
| RUB | 4,892,909 | USD | 75,050 | 2016年1月14日 | (8,307) |
| USD | 1,303,842 | EUR | 1,200,000 | 2016年1月14日 | (9,088) |
| GBP | 300,000 | USD | 454,842 | 2016年1月14日 | (10,351) |
| CNH | 3,731,340 | USD | 572,203 | 2016年3月16日 | (10,948) |
| MXN | 5,002,186 | USD | 300,265 | 2016年3月16日 | (12,401) |
| USD | 1,300,046 | EUR | 1,200,000 | 2016年1月14日 | (12,884) |
| EUR | 1,200,000 | USD | 1,326,036 | 2016年1月14日 | (13,106) |
| GBP | 525,000 | USD | 792,272 | 2016年1月13日 | (14,414) |
| MXN | 5,525,710 | USD | 332,791 | 2016年3月16日 | (14,799) |
| RUB | 13,113,100 | USD | 195,237 | 2016年1月27日 | (17,022) |
| RUB | 13,304,650 | USD | 198,791 | 2016年1月14日 | (17,306) |
| USD | 1,598,869 | PLN | 6,300,000 | 2016年1月14日 | (25,770) |
| USD | 1,250,000 | JPY | 154,247,500 | 2016年1月14日 | (31,145) |
| CAD | 830,000 | AUD | 880,063 | 2016年1月14日 | (42,342) |
| USD | 5,122,827 | EUR | 4,718,000 | 2016年2月10日 | (42,585) |
| BRL | 9,060,000 | USD | 2,387,477 | 2016年1月5日 | (49,039) |
| MXN | 19,700,000 | USD | 1,189,172 | 2016年1月19日 | (51,004) |
| RUB | 38,860,800 | USD | 584,884 | 2016年1月14日 | (54,793) |
| USD | 2,282,617 | BRL | 9,060,000 | 2016年1月5日 | (55,821) |
| NOK | 39,300,000 | USD | 4,544,613 | 2016年1月14日 | (58,411) |
| USD | 2,701,648 | AUD | 3,800,000 | 2016年1月14日 | (67,979) |
| USD | 6,383,847 | CHF | 6,400,000 | 2016年1月14日 | (75,238) |

| 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) |
|------|------------|------|-------------|------------|--------------------|
| GBP | 2,000,000 | USD | 3,046,413 | 2016年1月14日 | (83,138) |
| USD | 4,789,644 | JPY | 588,000,000 | 2016年1月14日 | (94,149) |
| ZAR | 26,500,000 | USD | 1,853,017 | 2016年1月14日 | (134,869) |
| USD | 3,867,110 | SEK | 33,500,000 | 2016年1月14日 | (145,510) |
| USD | 18,641,961 | EUR | 17,300,000 | 2016年1月14日 | (286,118) |
| USD | 6,660,049 | NZD | 10,200,000 | 2016年1月14日 | (337,614) |
| | | | | | (3,160,945) |

注記2 - 先物契約

2015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 | 13 | FUT AUST 10YR BOND 6% | 2016年3月 | 1,210,328 | 9,940 |
| NZD | 15 | FUT NEW ZEALAND 3MO BILL | 2016年12月 | 10,230,117 | 2,521 |
| USD | 7 | FUT US NOTE 5YR 6% | 2016年3月 | 826,930 | (15,753) |
| JPY | 13 | FUT 3MO EUROYEN TFX | 2016年3月 | 2,693,987 | (269) |
| JPY | 5 | FUT 3MO EUROYEN TFX | 2016年9月 | 1,036,304 | (156) |
| | | | | 15,997,666 | (3,717) |
| <i>売り持ちポジション</i> | | | | | |
| EUR | (16) | FUT EUR OAT | 2016年3月 | (2,625,756) | 38,105 |
| EUR | (53) | FUT EURO BOBL 5YR 6% | 2016年3月 | (7,574,435) | 76,231 |
| EUR | (20) | FUT EURO BUND 10YR 6% | 2016年3月 | (3,454,344) | 48,123 |
| EUR | (5) | FUT EURO BUXL 30YR 4% | 2016年3月 | (827,931) | 19,249 |
| USD | (5) | FUT EURO FX CURRENCY | 2016年3月 | (683,250) | 4,244 |
| USD | (5) | FUT GBP CURRENCY | 2016年3月 | (463,531) | 7,669 |
| GBP | (32) | FUT LONG GILT 10YR 4% | 2016年3月 | (5,520,561) | 53,323 |
| USD | (5) | FUT MXM CURRENCY | 2016年3月 | (143,400) | 1,440 |
| USD | (6) | FUT RAND CURRENCY | 2016年3月 | (189,900) | 15,375 |
| USD | (21) | FUT US LONG BD 20YR 6% | 2016年3月 | (3,213,000) | 12,634 |
| USD | (159) | FUT US NOTE 10YR 6% | 2016年3月 | (19,961,954) | 112,731 |
| USD | (165) | FUT US NOTE 2YR 6% | 2016年3月 | (35,825,625) | 71,933 |
| USD | (9) | FUT US ULTRA BOND 30YR 6% | 2016年3月 | (1,416,094) | 5,251 |
| GBP | (70) | FUT 90DAY STERLING | 2017年12月 | (12,766,948) | 25,928 |
| AUD | (8) | FUT AUST 3YR BOND 6% | 2016年3月 | (650,975) | (3,421) |
| USD | (4) | FUT NEW ZEALAND DOLLAR | 2016年3月 | (272,280) | (6,660) |
| JPY | (55) | FUT 10YR MINI JGB | 2016年3月 | (6,805,588) | (13,227) |
| | | | | (102,395,572) | 468,928 |
| | | | | | 465,211 |

注記3 - 金利スワップ契約

2015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) |
|-----|-------------|---|------------|---------------|----------------|
| CAD | 1,900,000 | Receive Fixed (1.25%) - Pay Floating (3M CAD) | 2018年3月16日 | 0 | 10,406 |
| CAD | 2,660,000 | Receive Fixed (1.75%) - Pay Floating (3M CAD) | 2021年3月16日 | 0 | 46,753 |
| USD | 5,500,000 | Receive Fixed (2.9225%) - Pay Floating (3M USD LIBOR) | 2021年6月24日 | 0 | 55,330 |
| USD | 1,400,000 | Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (3.2175%) | 2029年6月25日 | 0 | (53,444) |
| USD | 9,320,000 | Receive Fixed (2.81%) - Pay Floating (3M USD LIBOR) | 2022年9月2日 | 0 | 40,624 |
| USD | 2,200,000 | Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (3.0045%) | 2030年9月2日 | 0 | (28,243) |
| USD | 2,270,000 | Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (2.5%) | 2026年3月17日 | 0 | 24,740 |
| USD | 1,190,000 | Receive Fixed (1.5%) - Pay Floating (3M USD LIBOR) | 2018年3月16日 | 0 | 6,259 |
| USD | 900,000 | Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (2.25%) | 2023年3月16日 | 0 | (13,012) |
| USD | 3,360,000 | Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (2.5%) | 2026年3月16日 | 0 | (75,029) |
| USD | 600,000 | Receive Fixed (2.75%) - Pay Floating (3M USD LIBOR) | 2036年3月16日 | 0 | 16,388 |
| USD | 400,000 | Receive Floating (3M USD LIBOR) - Pay Fixed (2.75%) | 2046年3月16日 | 0 | (8,820) |
| JPY | 183,960,000 | Receive Fixed (0.5%) - Pay Floating (JPY LIBOR 6M) | 2026年3月16日 | 0 | 8,582 |
| NZD | 550,000 | Receive Floating (3M BBR) - Pay Fixed (3.5%) | 2026年3月16日 | 0 | 8,869 |
| AUD | 7,510,000 | Receive Fixed (2.25%) - Pay Floating (3M BBR) | 2018年12月7日 | (207) | (14,362) |
| AUD | 2,620,000 | Receive Fixed (3%) - Pay Floating (6M BBR) | 2026年3月16日 | 0 | (16,868) |
| AUD | 1,070,000 | Receive Fixed (2.5%) - Pay Floating (6M BBR) | 2021年3月16日 | 0 | (5,854) |
| SEK | 9,990,000 | Receive Floating (3M SEK-STIBOR) - Pay Fixed (1.5%) | 2026年3月16日 | 0 | 20,739 |
| SEK | 15,170,000 | Receive Floating (3M SEK-STIBOR) - Pay Fixed (0.75%) | 2021年3月16日 | 0 | 6,343 |
| SEK | 39,510,000 | Receive Fixed (0.05%) - Pay Floating (3M SEK-STIBOR) | 2018年3月16日 | 0 | 7,650 |
| EUR | 6,430,000 | Receive Fixed (1.5675%) - Pay Floating (6M EUR-EURIBOR) | 2025年5月11日 | 0 | 7,619 |
| EUR | 2,410,000 | Receive Floating (6M EUR-EURIBOR) - Pay Fixed (1.695%) | 2035年5月11日 | 0 | 95,155 |
| EUR | 2,320,000 | Receive Fixed (2%) - Pay Floating (6M EUR-EURIBOR) | 2025年9月16日 | 0 | 44,501 |
| EUR | 2,110,000 | Receive Fixed (1.5%) - Pay Floating (6M EUR-EURIBOR) | 2026年3月17日 | 0 | (26,035) |
| EUR | 2,050,000 | Receive Fixed (0.25%) - Pay Floating (6M EUR-EURIBOR) | 2019年3月16日 | 0 | 9,576 |
| EUR | 2,460,000 | Receive Floating (6M EUR-EURIBOR) - Pay Fixed (0.5%) | 2021年3月16日 | 0 | (15,377) |
| EUR | 5,490,000 | Receive Fixed (1%) - Pay Floating (6M EUR-EURIBOR) | 2026年3月16日 | 0 | (24,555) |
| GBP | 100,000 | Receive Floating (6M GBP-LIBOR) - Pay Fixed (2.1%) | 2037年6月8日 | (122) | 2,563 |
| GBP | 1,760,000 | Receive Floating (6M GBP-LIBOR) - Pay Fixed (2.75%) | 2025年9月16日 | 0 | (35,175) |
| GBP | 1,040,000 | Receive Floating (6M GBP-LIBOR) - Pay Fixed (0.845%) | 2018年1月4日 | 0 | 7,524 |
| GBP | 2,640,000 | Receive Floating (6M GBP-LIBOR) - Pay Fixed (1.5%) | 2018年3月16日 | 0 | (22,760) |
| GBP | 360,000 | Receive Floating (6M GBP-LIBOR) - Pay Fixed (2.25%) | 2026年3月16日 | 0 | (9,858) |
| GBP | 1,190,000 | Receive Floating (6M GBP-LIBOR) - Pay Fixed (2.25%) | 2046年3月16日 | 0 | (33,062) |
| | | | | (329) | 37,167 |

注記4 - クレジット・デフォルト・スワップ契約

2015年12月31日現在、ファンドは以下の未決済クレジット・デフォルト・スワップ契約を有していた。

| 通貨 | 額面 | 銘柄名 | 満期日 | 未実現損益 (米ドル) |
|-----------------------|-----------|------------------------------------|-------------|-------------------------|
| <i>プロテクション買いポジション</i> | | | | |
| USD | 2,450,000 | CDX NA HY 25 5Y 500 BP 5% 20/12/20 | 2020年12月20日 | (23,676) |
| | | | | <u>(23,676)</u> |
| <i>プロテクション売りポジション</i> | | | | |
| USD | 1,150,000 | CDX CMBX AAA 7 50BP 0.5% 17/01/47 | 2047年1月17日 | (39,527) |
| USD | 1,700,000 | CDX CMBX AAA 8 50BP 0.5% 17/10/57 | 2057年10月17日 | (81,473) |
| USD | 6,125,000 | CDX NA IG 25 5Y 100BP 1% 20/12/20 | 2020年12月20日 | 32,186 |
| | | | | <u>(88,814)</u> |
| | | | | <u>(112,490)</u> |

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第13期（決算日2015年8月19日）

作成対象期間（2014年8月20日～2015年8月19日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | 騰落率 | | 債組入比率 | 債券率 | 債先物比率 | 債券率 | 純資産額 |
|-----------------|-------------|-----|----------|-----------|-----|--------|-----|--------------|
| | | 期騰 | 落中率 | | | | | |
| 9期(2011年8月19日) | 円 10,170 | | % 0.1 | % 91.3 | | % - | | 百万円 5,916 |
| 10期(2012年8月20日) | 10,181 | | 0.1 | 100.7 | | - | | 2,216 |
| 11期(2013年8月19日) | 10,191 | | 0.1 | 80.9 | | - | | 5,297 |
| 12期(2014年8月19日) | 10,199 | | 0.1 | 59.7 | | - | | 8,648 |
| 13期(2015年8月19日) | 10,206 | | 0.1 | 44.7 | | - | | 22,034 |

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

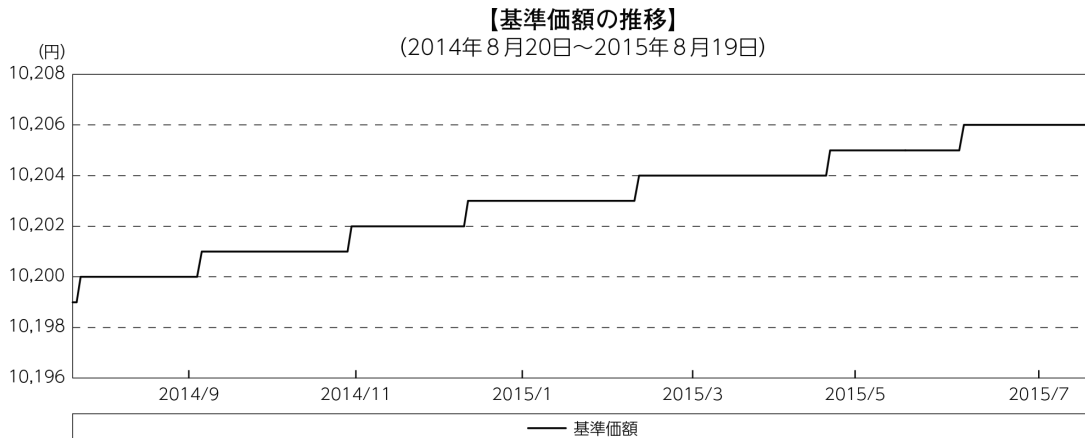
| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | | 債組入比率 | 債券率 | 債先物比率 | 債券率 |
|--------------------|-------------|-----|--------|-------|-----------|-------|--------|
| | | 騰 | 落率 | | | | |
| (期首) 2014年8月19日 | 円 10,199 | | % - | | % 59.7 | | % - |
| 8月末 | 10,200 | | 0.0 | | 70.0 | | - |
| 9月末 | 10,200 | | 0.0 | | 62.3 | | - |
| 10月末 | 10,201 | | 0.0 | | 52.6 | | - |
| 11月末 | 10,202 | | 0.0 | | 52.6 | | - |
| 12月末 | 10,202 | | 0.0 | | 54.3 | | - |
| 2015年1月末 | 10,203 | | 0.0 | | 90.0 | | - |
| 2月末 | 10,203 | | 0.0 | | 59.5 | | - |
| 3月末 | 10,204 | | 0.0 | | 52.3 | | - |
| 4月末 | 10,204 | | 0.0 | | 62.6 | | - |
| 5月末 | 10,205 | | 0.1 | | 59.8 | | - |
| 6月末 | 10,205 | | 0.1 | | 41.2 | | - |
| 7月末 | 10,206 | | 0.1 | | 46.2 | | - |
| (期末) 2015年8月19日 | 10,206 | | 0.1 | | 44.7 | | - |

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



○基準価額の変動要因

* 基準価額は0.07%の上昇

基準価額は、期首10,199円から期末は10,206円となりました。

投資している短期有価証券等からのインカムゲイン（利息収入）。

○投資環境

国内経済は、企業収益や雇用・所得環境が改善する中で緩やかな回復を続けてきましたが、4-6月期は個人消費や輸出といった内外需が落ち込み、景気回復が小休止状態にあることを示しました。

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、2014年10月の金融政策決定会合では、資産買入れ額の拡大および長期国債買入れの平均残存年限の長期化を図るなど金融緩和を強化しました。

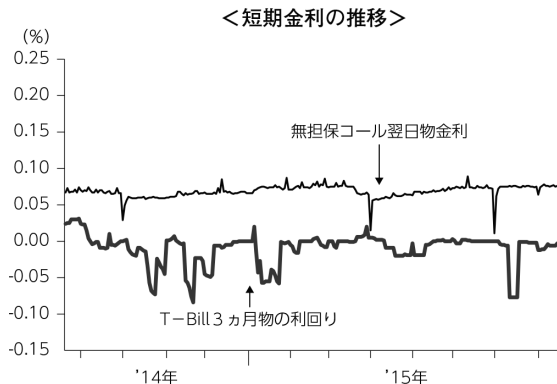
・無担保コール翌日物金利の推移

期を通じて概ね0.06%台から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

2014年9月以降、国内投資家の恒常的な国債需要に加え、日本銀行による買入や海外からの資金流入などによる需給ひっ迫から利回りは低下し、マイナスとなりました。

その後、一時的な需給の緩みにより利回りがプラス圏に戻る局面もありましたが、期末にかけて概ねマイナス圏で推移しました。



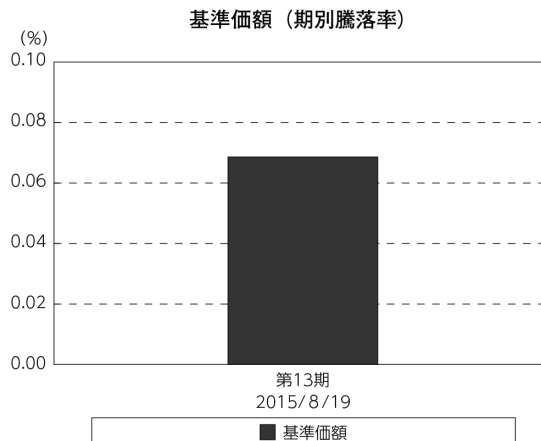
○当ファンドのポートフォリオ

今期の運用につきましては、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うことで流動性の確保を図りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎今後の運用方針

今後も、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 万口当たりの費用明細

(2014年8月20日～2015年8月19日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|----------------------------|-----------------|-----------------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 (そ の 他) | 円 0 (0) | % 0.002 (0.002) | (a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 0 | 0.002 | |
| 期中の平均基準価額は、10,202円です。 | | | |

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○ 売買及び取引の状況

(2014年8月20日～2015年8月19日)

公社債

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|--------|----------------|------------|----------------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 内 | 国債証券 | 57,121,186 | 33,710,730 (24,409,350) |
| | 地方債証券 | 3,262,292 | — (1,970,000) |
| | 特殊債券 | 10,876,852 | — (7,504,000) |
| | 社債券（投資法人債券を含む） | 3,312,770 | — (2,240,000) |

*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

その他有価証券

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|--------|-------------|-----------|------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 内 | コマーシャル・ペーパー | 7,297,610 | — (5,300,000) |

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は償還等による増減分です。

○利害関係人との取引状況等

(2014年8月20日～2015年8月19日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ % | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ % |
|-----|---------------|--------------------|--------------------|-----------|--------------------|--------------------|
| | | | | | | |
| 公社債 | 百万円 40,912 | 百万円 5,799 | % 14.2 | 百万円 50 | 百万円 — | % — |

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

○組入資産の明細

(2015年8月19日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | |
|---------------------|--------------------------|--------------------------|----------------|--------------------|-----------|----------|----------------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うちBB格以下 組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 国債証券 | 1,180,000 (1,130,000) | 1,180,008 (1,129,999) | 5.4 (5.1) | — (—) | — (—) | — (—) | 5.4 (5.1) |
| 地方債証券 | 1,281,600 (1,281,600) | 1,287,899 (1,287,899) | 5.8 (5.8) | — (—) | — (—) | — (—) | 5.8 (5.8) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 4,686,000 (4,686,000) | 4,703,401 (4,703,401) | 21.3 (21.3) | — (—) | — (—) | — (—) | 21.3 (21.3) |
| 金融債券 | 1,470,000 (1,470,000) | 1,473,440 (1,473,440) | 6.7 (6.7) | — (—) | — (—) | — (—) | 6.7 (6.7) |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 1,200,000 (1,200,000) | 1,207,103 (1,207,103) | 5.5 (5.5) | — (—) | — (—) | — (—) | 5.5 (5.5) |
| 合 計 | 9,817,600 (9,767,600) | 9,851,853 (9,801,844) | 44.7 (44.5) | — (—) | — (—) | — (—) | 44.7 (44.5) |

* () 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。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 柄 | 当期末 | | | |
|--------------------|--------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | | 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333回 | 0.1 | 50,000 | 50,009 | 2015/10/15 |
| 小 | 計 | | 1,180,000 | 1,180,008 | |
| 地方債証券 | | | | | |
| 東京都 | 公募第625回 | 1.41 | 200,000 | 200,218 | 2015/9/18 |
| 北海道 | 公募平成17年度第6回 | 1.4 | 105,100 | 105,142 | 2015/8/31 |
| 北海道 | 公募平成17年度第12回 | 1.6 | 50,000 | 50,365 | 2016/2/24 |
| 神奈川県 | 公募第136回 | 1.5 | 90,000 | 90,421 | 2015/12/28 |
| 大阪府 | 公募第284回 | 1.6 | 300,000 | 301,207 | 2015/11/27 |
| 兵庫県 | 公募平成18年度第7回 | 2.1 | 80,000 | 81,503 | 2016/7/27 |
| 新潟県 | 公募平成18年度第1回 | 2.1 | 6,500 | 6,617 | 2016/7/27 |
| 共同発行市場地方債 | 公募第31回 | 1.5 | 50,000 | 50,123 | 2015/10/23 |
| 共同発行市場地方債 | 公募第32回 | 1.6 | 100,000 | 100,391 | 2015/11/25 |
| 共同発行市場地方債 | 公募第34回 | 1.4 | 200,000 | 201,130 | 2016/1/25 |
| 共同発行市場地方債 | 公募第35回 | 1.6 | 100,000 | 100,778 | 2016/2/25 |
| 小 | 計 | | 1,281,600 | 1,287,899 | |
| 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 | 300,095 | 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 | 352,411 | 2015/9/22 |
| 首都高速道路債券 | 政府保証第199回 | 1.4 | 50,000 | 50,018 | 2015/8/28 |
| 阪神高速道路債券 | 政府保証第148回 | 1.3 | 20,000 | 20,028 | 2015/9/30 |
| 本州四国連絡橋債券 | 政府保証第27回 | 1.4 | 300,000 | 300,141 | 2015/8/31 |
| 公営企業債券 | 政府保証第861回 | 1.6 | 29,000 | 29,256 | 2016/3/17 |
| 公営企業債券 | 政府保証第862回 | 1.8 | 117,000 | 118,337 | 2016/4/20 |
| 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 | 100,499 | 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 | 593,701 | 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 | 562,454 | 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 | 171,994 | 2016/4/26 |
| 首都高速道路債券 | 政府保証第1回 | 1.6 | 400,000 | 403,726 | 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 | 199,993 | 2015/12/18 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 2年第1回 | 0.135 | 200,000 | 200,056 | 2016/2/26 |
| 首都高速道路社債 | 第6回 | 0.315 | 100,000 | 100,024 | 2015/9/24 |
| 阪神高速道路社債 | 財投機関債第6回 | 0.589 | 100,000 | 100,166 | 2015/12/18 |
| 中日本高速道路債券 | 財投機関債第20回 | 0.417 | 100,000 | 100,025 | 2015/9/18 |
| 中日本高速道路社債 | 財投機関債第37回 | 0.385 | 200,000 | 200,314 | 2016/2/26 |
| 西日本高速道路 | 第16回 | 0.246 | 200,000 | 200,038 | 2015/9/18 |
| 西日本高速道路 | 第17回 | 0.196 | 300,000 | 300,113 | 2015/12/18 |
| 小 | 計 | | 4,686,000 | 4,703,401 | |
| 金融債券 | | | | | |
| 商工債券 | 利付第724回い号 | 0.5 | 320,000 | 320,138 | 2015/9/25 |
| 商工債券 | 利付第733回い号 | 0.55 | 300,000 | 301,185 | 2016/6/27 |

| 銘 | 柄 | 当 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734回い号 | 0.55 | 150,000 | 150,655 | 2016/7/27 |
| 農林債券 | 利付第723回い号 | 0.55 | 150,000 | 150,020 | 2015/8/27 |
| 農林債券 | 利付第724回い号 | 0.5 | 50,000 | 50,021 | 2015/9/25 |
| 農林債券 | 利付第733回い号 | 0.55 | 100,000 | 100,392 | 2016/6/27 |
| 商工債券 | 利付(3年)第152回 | 0.2 | 100,000 | 100,013 | 2015/9/25 |
| 商工債券 | 利付(3年)第153回 | 0.2 | 100,000 | 100,026 | 2015/10/27 |
| 商工債券 | 利付(3年)第161回 | 0.25 | 100,000 | 100,144 | 2016/6/27 |
| 商工債券 | 利付(10年)第2回 | 1.78 | 100,000 | 100,841 | 2016/2/19 |
| 小 | 計 | | 1,470,000 | 1,473,440 | |
| 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 | 200,415 | 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 | 100,429 | 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 | 202,217 | 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 | 502,336 | 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 | 100,066 | 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 | 101,639 | 2016/6/20 |
| 小 | 計 | | 1,200,000 | 1,207,103 | |
| 合 | 計 | | 9,817,600 | 9,851,853 | |

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

国内その他有価証券

| 区 分 | 当 期 末 | |
|-------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| コマーシャル・ペーパー | 千円 2,499,141 | % 11.3 |

* 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2015年8月19日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 9,851,853 | % 44.3 |
| その他有価証券 | 2,499,141 | 11.2 |
| コール・ローン等、その他 | 9,864,830 | 44.5 |
| 投資信託財産総額 | 22,215,824 | 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 (2015年8月19日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 22,215,824,811 |
| コール・ローン等 | 847,502,284 |
| 公社債(評価額) | 9,851,853,649 |
| 其他有価証券 | 2,499,141,851 |
| 未収利息 | 15,014,658 |
| 前払費用 | 12,080,826 |
| 差入保証金 | 8,990,231,543 |
| (B) 負債 | 181,800,841 |
| 未払金 | 181,483,841 |
| 未払解約金 | 317,000 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 22,034,023,970 |
| 元本 | 21,588,342,274 |
| 次期繰越損益金 | 445,681,696 |
| (D) 受益権総口数 | 21,588,342,274口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,206円 |

(注) 期首元本額8,478百万円、期中追加設定元本額20,130百万円、期中一部解約元本額7,020百万円、計算口数当たり純資産額10,206円。

○損益の状況 (2014年8月20日～2015年8月19日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 61,355,124 |
| 受取利息 | 58,968,909 |
| 其他収益金 | 2,386,215 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 49,857,397 |
| 売買益 | 19,664 |
| 売買損 | △ 49,877,061 |
| (C) 保管費用等 | △ 261,886 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 11,235,841 |
| (E) 前期繰越損益金 | 169,135,352 |
| (F) 追加信託差損益金 | 408,020,917 |
| (G) 解約差損益金 | △142,710,414 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 445,681,696 |
| 次期繰越損益金(H) | 445,681,696 |

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名 | 当期末 元本額 |
|--|------------|
| | 百万円 |
| バンクローンファンド (為替ヘッジあり) 2014-09 | 98 |
| バンクローンファンド (為替ヘッジあり) 2015-06 | 146 |
| 野村アフリカ株投資 マネーボール・ファンド | 20 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信 (マネーボールファンド) 年2回決算型 | 90 |
| 野村新中國株投資 マネーボール・ファンド | 78 |
| 野村日本ブランド株投資 (マネーボールファンド) 年2回決算型 | 745 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信 (マネーボールファンド) 年2回決算型 | 9 |
| 野村ビクテ・ジェネリック&ゲノム マネーボール・ファンド | 1 |
| 野村RCM・グリーン・テックロジック マネーボール・ファンド | 1 |
| 野村新興国消費関連株投信 マネーボール・ファンド | 5 |
| 野村世界業種別投資シリーズ (マネーボール・ファンド) | 12 |
| ノムラ・アジア・シリーズ (マネーボール・ファンド) | 2,033 |
| 野村新エマージング債券投信 (マネーボールファンド) 年2回決算型 | 5 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信 (マネーボールファンド) 年2回決算型 | 8 |
| 野村グローバルCB投信 (マネーボールファンド) 年2回決算型 | 6 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信 (マネーボールファンド) 年2回決算型 | 133 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信 (マネーボールファンド) 年2回決算型 | 0 |
| 野村日本スマートシティ株投資 マネーボールファンド | 1 |
| 野村世界高金利通貨投信 | 151 |
| 野村新世界高金利通貨投信 | 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・イールド債券投信 (円コース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信 (米ドルコース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信 (ユーロコース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信 (豪ドルコース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信 (ブラジルレアルコース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信 (南アフリカランドコース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信 (トルコリラコース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信 (円コース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信 (米ドルコース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信 (ユーロコース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信 (豪ドルコース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信 (南アフリカランドコース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信 (トルコリラコース) 年2回決算型 | 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 (円コース) 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・イールド債券投信 (円コース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信 (豪ドルコース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信 (ブラジルレアルコース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信 (南アフリカランドコース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信 (トルコリラコース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信 (円コース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信 (豪ドルコース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信 (南アフリカランドコース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信 (トルコリラコース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース | 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信 Bコース | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (円コース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (米ドルコース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (豪ドルコース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (ブラジルレアルコース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (南アフリカランドコース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (中国元コース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (インドネシアルピアコース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (円コース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (米ドルコース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (豪ドルコース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (南アフリカランドコース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (中国元コース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (インドネシアルピアコース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信 (円コース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信 (資源国通貨コース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信 (アジア通貨コース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信 (円コース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信 (資源国通貨コース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信 (アジア通貨コース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (円コース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (資源国通貨コース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (アジア通貨コース) 毎月分配型 | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (円コース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (資源国通貨コース) 年2回決算型 | 0 |
| 野村新エマージング債券投信 (アジア通貨コース) 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 (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信 (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信 (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信 (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信 (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信 (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信 (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信 (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信 (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信 (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信 (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信 (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信 (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信 (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 |
| 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 |

| ファンド名 | 当期末 |
|--------------------------------------|-----|
| | 元本額 |
| | 百万円 |
| 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(ブラジルリアルコース)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(インドルピーコース)毎月分配型 | 0 |
| 野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)毎月分配型 | 0 |
| 野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)年2回決算型 | 0 |
| 野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)年2回決算型 | 0 |
| 野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)年2回決算型 | 0 |
| 野村通貨選択日本株投信(ブラジルリアルコース)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 |
| 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 |

| ファンド名 | 当期末 |
|---|-------|
| | 元本額 |
| | 百万円 |
| 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(メキシコペソコース)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 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)毎月分配型 | 0 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)毎月分配型 | 0 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)毎月分配型 | 0 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)年2回決算型 | 0 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)年2回決算型 | 0 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)年2回決算型 | 0 |
| 野村新興国高配当株トリアルウィング ブラジルリアル毎月分配型 | 0 |
| ピムコ・世界インカム戦略ファンド(円コース) | 0 |
| ピムコ・世界インカム戦略ファンド(米ドルコース) | 0 |
| ピムコ・世界インカム戦略ファンド(世界通貨分散コース) | 0 |
| ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け) | 0 |
| 野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け) | 0 |
| ノムラ THE ASIA Aコース | 0 |
| ノムラ THE ASIA Bコース | 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 |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(非課税適格機関投資家専用) | 5,276 |
| 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) | 3,422 |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)2プライス(適格機関投資家専用) | 2,296 |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Dプライス(適格機関投資家専用) | 4,635 |
| 日本株インカムプラスα(公社債運用移行型)1305(適格機関投資家転売制限付) | 1,186 |
| 日本株インカムプラスα(公社債運用移行型)1308(適格機関投資家転売制限付) | 1,019 |
| 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。

○お知らせ

- ①デリバティブ取引等に係る投資制限に関する所要の約款変更を行いました。
＜変更適用日：2014年12月4日＞

- ②信用リスク集中回避のための投資制限に関する所要の約款変更を行いました。
＜変更適用日：2015年2月23日＞

< 「野村グローバルボンド投信（通貨選択型）」のお申し込み時の留意点 >

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

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

(2016年8月8日現在)

| 年 月 | 日 |
|---------|---------|
| 2016年8月 | 15、29 |
| 9月 | 5 |
| 10月 | — |
| 11月 | 1、11、24 |
| 12月 | 26、27 |

※2016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。