

野村米国好利回り社債投信 (毎月分配型) Cコース/Dコース

運用報告書(全体版)

第180期(決算日2022年1月11日) 第181期(決算日2022年2月8日) 第182期(決算日2022年3月8日)
第183期(決算日2022年4月8日) 第184期(決算日2022年5月9日) 第185期(決算日2022年6月8日)

作成対象期間(2021年12月9日~2022年6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。

| | Cコース | Dコース |
|--------|---|---|
| 商品分類 | 追加型投信/海外/債券 | |
| 信託期間 | 2006年11月30日から2026年12月8日までです。 | |
| 運用方針 | 野村米国好利回り社債投信(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、主として米国ドル建ての高利回り事業債(ハイ・イールド・ボンド)に投資し、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目的として運用を行ないます。 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。 | 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。 |
| 主な投資対象 | 野村米国好利回り社債投信Cコース/Dコース マザーファンド | マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、公社債等に直接投資する場合があります。 米国ドル建ての高利回り事業債を主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | 野村米国好利回り社債投信Cコース/Dコース マザーファンド | 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 |
| 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安定分配を行ないます。ただし、基準価額水準等を勘案し、安定分配相当額のほか、委託者が決定する額を付加して分配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ないます。 | |

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



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/>

<Cコース>

○最近30期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | 標準価額 | | ベンチマーク | 新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率 | | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|------------------|---------------|------|--------|--------|----------------------------|------|--------|--------|-------|
| | | 税金配分 | み騰落率 | | 期騰落率 | 期騰落率 | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | 百万円 |
| 156期(2020年1月8日) | 7,481 | 50 | 1.7 | 206.63 | 1.8 | 0.1 | 90.3 | — | 1,841 |
| 157期(2020年2月10日) | 7,455 | 30 | 0.1 | 206.76 | 0.1 | 0.1 | 93.0 | — | 1,735 |
| 158期(2020年3月9日) | 7,194 | 30 | △ 3.1 | 201.05 | △ 2.8 | 0.0 | 84.0 | — | 1,596 |
| 159期(2020年4月8日) | 6,217 | 30 | △ 13.2 | 176.55 | △ 12.2 | 0.0 | 90.1 | — | 1,359 |
| 160期(2020年5月8日) | 6,478 | 30 | 4.7 | 185.30 | 5.0 | 0.0 | 90.4 | — | 1,430 |
| 161期(2020年6月8日) | 6,928 | 30 | 7.4 | 199.02 | 7.4 | 0.0 | 95.1 | — | 1,501 |
| 162期(2020年7月8日) | 6,811 | 30 | △ 1.3 | 197.11 | △ 1.0 | 0.0 | 96.2 | — | 1,424 |
| 163期(2020年8月11日) | 7,042 | 30 | 3.8 | 204.77 | 3.9 | 0.0 | 93.2 | — | 1,422 |
| 164期(2020年9月8日) | 7,059 | 30 | 0.7 | 205.26 | 0.2 | 0.0 | 94.6 | — | 1,416 |
| 165期(2020年10月8日) | 7,047 | 30 | 0.3 | 205.24 | △ 0.0 | — | 93.4 | — | 1,349 |
| 166期(2020年11月9日) | 7,124 | 30 | 1.5 | 208.44 | 1.6 | — | 91.8 | — | 1,331 |
| 167期(2020年12月8日) | 7,347 | 30 | 3.6 | 214.20 | 2.8 | — | 93.4 | — | 1,331 |
| 168期(2021年1月8日) | 7,400 | 30 | 1.1 | 216.47 | 1.1 | — | 93.9 | — | 1,315 |
| 169期(2021年2月8日) | 7,449 | 30 | 1.1 | 218.30 | 0.8 | — | 96.1 | — | 1,299 |
| 170期(2021年3月8日) | 7,394 | 30 | △ 0.3 | 217.06 | △ 0.6 | — | 98.6 | — | 1,265 |
| 171期(2021年4月8日) | 7,456 | 30 | 1.2 | 219.22 | 1.0 | — | 98.7 | — | 1,257 |
| 172期(2021年5月10日) | 7,487 | 30 | 0.8 | 220.71 | 0.7 | — | 95.3 | — | 1,231 |
| 173期(2021年6月8日) | 7,485 | 30 | 0.4 | 221.51 | 0.4 | — | 94.4 | — | 1,225 |
| 174期(2021年7月8日) | 7,556 | 30 | 1.3 | 224.58 | 1.4 | — | 94.6 | — | 1,234 |
| 175期(2021年8月10日) | 7,460 | 30 | △ 0.9 | 223.73 | △ 0.4 | — | 93.4 | — | 1,209 |
| 176期(2021年9月8日) | 7,508 | 30 | 1.0 | 225.89 | 1.0 | — | 91.8 | — | 1,202 |
| 177期(2021年10月8日) | 7,461 | 30 | △ 0.2 | 225.03 | △ 0.4 | — | 94.5 | — | 1,194 |
| 178期(2021年11月8日) | 7,472 | 30 | 0.5 | 226.33 | 0.6 | — | 94.5 | — | 1,187 |
| 179期(2021年12月8日) | 7,395 | 30 | △ 0.6 | 225.51 | △ 0.4 | — | 92.8 | — | 1,168 |
| 180期(2022年1月11日) | 7,324 | 30 | △ 0.6 | 224.01 | △ 0.7 | — | 94.5 | — | 1,154 |
| 181期(2022年2月8日) | 7,144 | 30 | △ 2.0 | 219.43 | △ 2.0 | — | 95.1 | — | 1,078 |
| 182期(2022年3月8日) | 7,016 | 30 | △ 1.4 | 216.46 | △ 1.4 | — | 97.8 | — | 1,003 |
| 183期(2022年4月8日) | 6,891 | 30 | △ 1.4 | 213.50 | △ 1.4 | — | 99.1 | — | 981 |
| 184期(2022年5月9日) | 6,611 | 30 | △ 3.6 | 205.55 | △ 3.7 | — | 93.4 | — | 942 |
| 185期(2022年6月8日) | 6,587 | 30 | 0.1 | 206.47 | 0.5 | — | 95.7 | — | 932 |

* 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、「新株予約権付社債（転換社債）組入比率」、「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。

* ベンチマーク（＝ICE BofA US High Yield Constrained Index（円ヘッジベース））は、ICE BofA US High Yield Constrained Index（US\$ベース）をもとに、当社が独自にヘッジコストを考慮して円換算したものです。なお、ベンチマークは設定時を100として指数化しています。
(出所および許可) ICE Data Indices, LLC

<Cコース>

○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 | | ベンチマ ー ク | | 新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率 | 債 券 組入比率 | 債 券 先物比率 |
|-------|------------------------|--------|------|----------|------|----------------------------|-------------|-------------|
| | | 騰 落 率 | | 騰 落 率 | | | | |
| 第180期 | (期 首) 2021年12月 8 日 | 円 | % | 225.51 | % | % | % | % |
| | 12月末 | 7,395 | — | — | — | — | 92.8 | — |
| | (期 末) 2022年 1 月11日 | 7,439 | 0.6 | 226.72 | 0.5 | — | 94.0 | — |
| 第181期 | (期 首) 2022年 1 月11日 | 7,354 | △0.6 | 224.01 | △0.7 | — | 94.5 | — |
| | 1 月末 | 7,324 | — | 224.01 | — | — | 94.5 | — |
| | (期 末) 2022年 2 月 8 日 | 7,198 | △1.7 | 220.17 | △1.7 | — | 95.2 | — |
| 第182期 | (期 首) 2022年 2 月 8 日 | 7,174 | △2.0 | 219.43 | △2.0 | — | 95.1 | — |
| | 2 月末 | 7,144 | — | 219.43 | — | — | 95.1 | — |
| | (期 末) 2022年 3 月 8 日 | 7,092 | △0.7 | 217.86 | △0.7 | — | 93.8 | — |
| 第183期 | (期 首) 2022年 3 月 8 日 | 7,046 | △1.4 | 216.46 | △1.4 | — | 97.8 | — |
| | 3 月末 | 7,016 | — | 216.46 | — | — | 97.8 | — |
| | (期 末) 2022年 4 月 8 日 | 7,004 | △0.2 | 216.09 | △0.2 | — | 98.7 | — |
| 第184期 | (期 首) 2022年 4 月 8 日 | 6,921 | △1.4 | 213.50 | △1.4 | — | 99.1 | — |
| | 4 月末 | 6,891 | — | 213.50 | — | — | 99.1 | — |
| | (期 末) 2022年 5 月 9 日 | 6,758 | △1.9 | 209.65 | △1.8 | — | 92.8 | — |
| 第185期 | (期 首) 2022年 5 月 9 日 | 6,641 | △3.6 | 205.55 | △3.7 | — | 93.4 | — |
| | 5 月末 | 6,611 | — | 205.55 | — | — | 93.4 | — |
| | (期 末) 2022年 6 月 8 日 | 6,692 | 1.2 | 208.67 | 1.5 | — | 91.7 | — |
| | | 6,617 | 0.1 | 206.47 | 0.5 | — | 95.7 | — |

*ベンチマーク=ICE BofA US High Yield Constrained Index (円ヘッジベース)。

*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、「新株予約権付社債(転換社債)組入比率」、「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。

<Dコース>

○最近30期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | 標準価額 | | ベンチマーク | | 新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|------------------|---------------|------|-------|--------|-------|----------------------------|--------|--------|-------|
| | | 税金 | み配金 | 期騰落 | 中率 | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | 百万円 |
| 156期(2020年1月8日) | 9,467 | 30 | 1.3 | 231.99 | 1.3 | 0.1 | 90.3 | — | 8,354 |
| 157期(2020年2月10日) | 9,613 | 30 | 1.9 | 236.61 | 2.0 | 0.1 | 92.8 | — | 8,410 |
| 158期(2020年3月9日) | 8,662 | 30 | △ 9.6 | 214.34 | △ 9.4 | 0.0 | 89.6 | — | 7,531 |
| 159期(2020年4月8日) | 7,958 | 30 | △ 7.8 | 200.85 | △ 6.3 | 0.0 | 89.2 | — | 6,829 |
| 160期(2020年5月8日) | 8,140 | 30 | 2.7 | 206.65 | 2.9 | 0.0 | 90.9 | — | 6,971 |
| 161期(2020年6月8日) | 8,955 | 30 | 10.4 | 228.55 | 10.6 | 0.0 | 93.7 | — | 7,651 |
| 162期(2020年7月8日) | 8,673 | 30 | △ 2.8 | 222.74 | △ 2.5 | 0.0 | 93.1 | — | 7,344 |
| 163期(2020年8月11日) | 8,858 | 30 | 2.5 | 228.23 | 2.5 | 0.0 | 93.4 | — | 7,457 |
| 164期(2020年9月8日) | 8,901 | 30 | 0.8 | 229.16 | 0.4 | 0.0 | 94.8 | — | 7,448 |
| 165期(2020年10月8日) | 8,876 | 30 | 0.1 | 228.73 | △ 0.2 | — | 93.7 | — | 7,399 |
| 166期(2020年11月9日) | 8,762 | 30 | △ 0.9 | 226.43 | △ 1.0 | — | 94.1 | — | 7,231 |
| 167期(2020年12月8日) | 9,111 | 30 | 4.3 | 234.45 | 3.5 | — | 94.6 | — | 7,439 |
| 168期(2021年1月8日) | 9,172 | 30 | 1.0 | 236.58 | 0.9 | — | 94.8 | — | 7,384 |
| 169期(2021年2月8日) | 9,391 | 30 | 2.7 | 242.60 | 2.5 | — | 95.2 | — | 7,467 |
| 170期(2021年3月8日) | 9,578 | 30 | 2.3 | 247.76 | 2.1 | — | 95.1 | — | 7,585 |
| 171期(2021年4月8日) | 9,794 | 30 | 2.6 | 253.69 | 2.4 | — | 95.5 | — | 7,622 |
| 172期(2021年5月10日) | 9,752 | 30 | △ 0.1 | 253.04 | △ 0.3 | — | 94.3 | — | 7,543 |
| 173期(2021年6月8日) | 9,820 | 30 | 1.0 | 255.60 | 1.0 | — | 94.2 | — | 7,573 |
| 174期(2021年7月8日) | 10,023 | 30 | 2.4 | 261.88 | 2.5 | — | 93.7 | — | 7,681 |
| 175期(2021年8月10日) | 9,888 | 30 | △ 1.0 | 260.47 | △ 0.5 | — | 92.9 | — | 7,545 |
| 176期(2021年9月8日) | 9,955 | 30 | 1.0 | 262.84 | 0.9 | — | 91.5 | — | 7,553 |
| 177期(2021年10月8日) | 10,034 | 30 | 1.1 | 265.40 | 1.0 | — | 93.0 | — | 7,595 |
| 178期(2021年11月8日) | 10,228 | 30 | 2.2 | 271.52 | 2.3 | — | 94.2 | — | 7,664 |
| 179期(2021年12月8日) | 10,130 | 30 | △ 0.7 | 270.52 | △ 0.4 | — | 93.0 | — | 7,542 |
| 180期(2022年1月11日) | 10,206 | 30 | 1.0 | 273.07 | 0.9 | — | 93.8 | — | 7,520 |
| 181期(2022年2月8日) | 9,964 | 30 | △ 2.1 | 267.45 | △ 2.1 | — | 94.2 | — | 7,285 |
| 182期(2022年3月8日) | 9,819 | 30 | △ 1.2 | 264.39 | △ 1.1 | — | 94.1 | — | 7,177 |
| 183期(2022年4月8日) | 10,344 | 30 | 5.7 | 279.73 | 5.8 | — | 94.8 | — | 7,504 |
| 184期(2022年5月9日) | 10,497 | 30 | 1.8 | 284.71 | 1.8 | — | 91.9 | — | 7,599 |
| 185期(2022年6月8日) | 10,652 | 30 | 1.8 | 290.72 | 2.1 | — | 93.2 | — | 7,649 |

* 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、「新株予約権付社債（転換社債）組入比率」、「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。

* ベンチマーク（＝ICE BofA US High Yield Constrained Index（円換算ベース））は、ICE BofA US High Yield Constrained Index（US\$ベース）をもとに、当社が独自に円換算したものです。なお、ベンチマークは設定時を100として指数化しています。
(出所および許可) ICE Data Indices, LLC

<Dコース>

○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 | | ベンチマ ー ク | | 新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率 | 債 券 組入比率 | 債 券 先物比率 |
|-------|------------------------|-------------|--------|----------|--------|----------------------------|-------------|-------------|
| | | 騰 落 率 | | 騰 落 率 | | | | |
| 第180期 | (期 首) 2021年12月 8 日 | 円 10,130 | % — | 270.52 | % — | % — | % 93.0 | % — |
| | 12月末 | 10,325 | 1.9 | 275.58 | 1.9 | — | 93.2 | — |
| | (期 末) 2022年 1 月11日 | 10,236 | 1.0 | 273.07 | 0.9 | — | 93.8 | — |
| 第181期 | (期 首) 2022年 1 月11日 | 10,206 | — | 273.07 | — | — | 93.8 | — |
| | 1 月末 | 10,039 | △1.6 | 268.67 | △1.6 | — | 94.3 | — |
| | (期 末) 2022年 2 月 8 日 | 9,994 | △2.1 | 267.45 | △2.1 | — | 94.2 | — |
| 第182期 | (期 首) 2022年 2 月 8 日 | 9,964 | — | 267.45 | — | — | 94.2 | — |
| | 2 月末 | 9,912 | △0.5 | 266.17 | △0.5 | — | 93.7 | — |
| | (期 末) 2022年 3 月 8 日 | 9,849 | △1.2 | 264.39 | △1.1 | — | 94.1 | — |
| 第183期 | (期 首) 2022年 3 月 8 日 | 9,819 | — | 264.39 | — | — | 94.1 | — |
| | 3 月末 | 10,376 | 5.7 | 279.88 | 5.9 | — | 95.5 | — |
| | (期 末) 2022年 4 月 8 日 | 10,374 | 5.7 | 279.73 | 5.8 | — | 94.8 | — |
| 第184期 | (期 首) 2022年 4 月 8 日 | 10,344 | — | 279.73 | — | — | 94.8 | — |
| | 4 月末 | 10,555 | 2.0 | 286.03 | 2.3 | — | 92.3 | — |
| | (期 末) 2022年 5 月 9 日 | 10,527 | 1.8 | 284.71 | 1.8 | — | 91.9 | — |
| 第185期 | (期 首) 2022年 5 月 9 日 | 10,497 | — | 284.71 | — | — | 91.9 | — |
| | 5 月末 | 10,436 | △0.6 | 283.55 | △0.4 | — | 92.3 | — |
| | (期 末) 2022年 6 月 8 日 | 10,682 | 1.8 | 290.72 | 2.1 | — | 93.2 | — |

*ベンチマーク=ICE BofA US High Yield Constrained Index (円換算ベース)。

*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

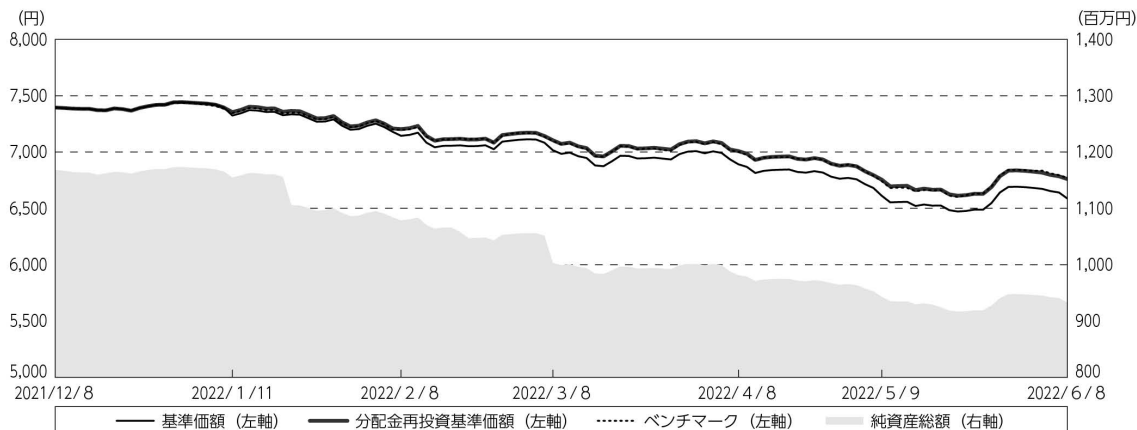
*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「新株予約権付社債(転換社債)組入比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

<Cコース>

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



第180期首：7,395円

第185期末：6,587円（既払分配金（税込み）：180円）

騰落率：△8.6%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2021年12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す。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) ベンチマークは、ICE BofA US High Yield Constrained Index（円ヘッジベース）です。ベンチマークは、作成期首（2021年12月8日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。

(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の7,395円から当作成期末には6,587円となりました。

- ・エネルギー高などによるインフレの高まりを背景にFRB（米連邦準備制度理事会）による積極的な金融引き締め観測が高まり、米国ハイ・イールド債券市場が下落したこと

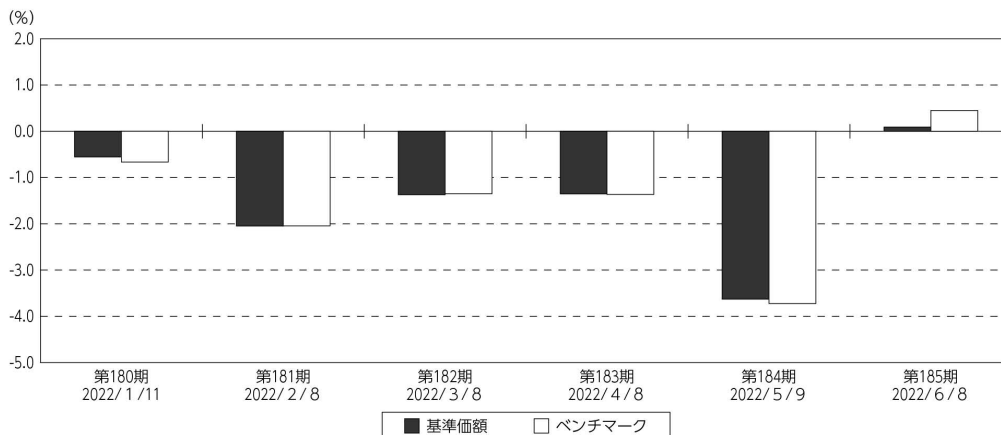
<Cコース>

○当ファンドのベンチマークとの差異

当作成期首から当作成期末の間に、基準価額の騰落率※は-8.6%となり、ベンチマークであるICE BofA US High Yield Constrained Index (円ヘッジベース)の-8.4%を0.2ポイント下回りました。主な差異要因は、銘柄選択効果などがマイナスに作用したことなどでした。

※基準価額の騰落率は、分配金(税込み)を再投資して算出しております。

基準価額とベンチマークの対比 (期別騰落率)



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、ICE BofA US High Yield Constrained Index (円ヘッジベース) です。

○分配金

収益分配金は、投資している債券から享受するインカムゲイン(利息収入)から、信託報酬等の経費を差し引いたものをベースに決定しました。

なお、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せん。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項 目 | 第180期 | 第181期 | 第182期 | 第183期 | 第184期 | 第185期 |
|-----------|---------------------------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|
| | 2021年12月9日～ 2022年1月11日 | 2022年1月12日～ 2022年2月8日 | 2022年2月9日～ 2022年3月8日 | 2022年3月9日～ 2022年4月8日 | 2022年4月9日～ 2022年5月9日 | 2022年5月10日～ 2022年6月8日 |
| 当期分配金 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 |
| (対基準価額比率) | 0.408% | 0.418% | 0.426% | 0.433% | 0.452% | 0.453% |
| 当期の収益 | 27 | 22 | 21 | 25 | 24 | 20 |
| 当期の収益以外 | 2 | 7 | 8 | 4 | 5 | 9 |
| 翌期繰越分配対象額 | 3,935 | 3,927 | 3,919 | 3,915 | 3,909 | 3,899 |

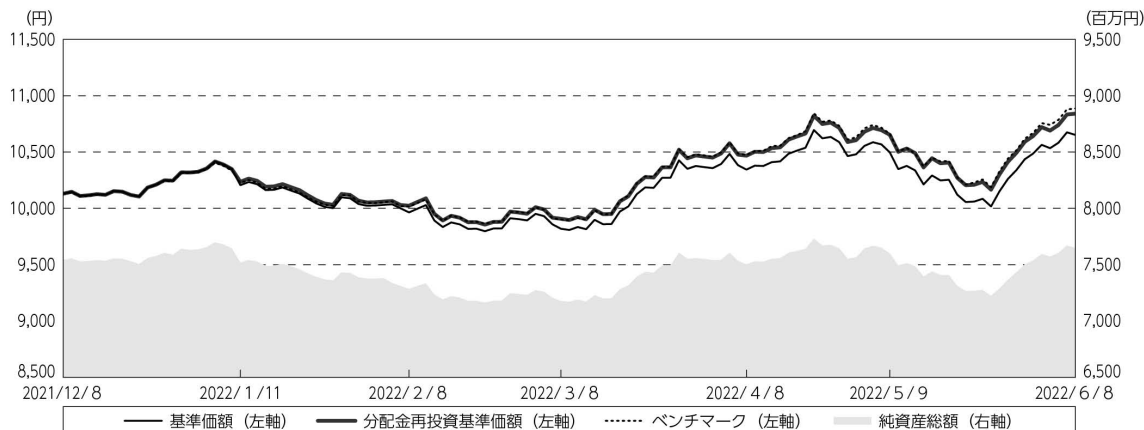
(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

<Dコース>

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



第180期首：10,130円

第185期末：10,652円（既払分配金（税込み）：180円）

騰落率：7.0%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2021年12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す。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、ICE BofA US High Yield Constrained Index（円換算ベース）です。ベンチマークは、作成期首（2021年12月8日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (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の10,130円から当作成期末には10,652円となりました。

- ・エネルギー高などによるインフレの高まりを背景にFRB（米連邦準備制度理事会）による積極的な金融引き締め観測が高まり、米国ハイ・イールド債券市場が下落したこと
- ・円・ドルの為替相場推移

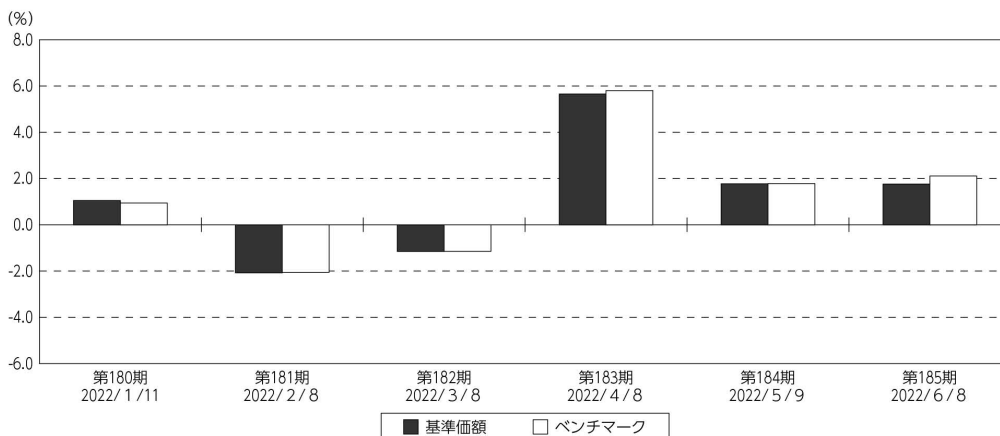
<Dコース>

○当ファンドのベンチマークとの差異

当作成期首から当作成期末の間に、基準価額の騰落率※は+7.0%となり、ベンチマークであるICE BofA US High Yield Constrained Index（円換算ベース）の+7.5%を0.5ポイント下回りました。主な差異要因は、銘柄選択効果などがマイナスに作用したことなどでした。

※基準価額の騰落率は、分配金（税込み）を再投資して算出しております。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、ICE BofA US High Yield Constrained Index（円換算ベース）です。

○分配金

収益分配金は、投資している債券から享受するインカムゲイン（利息収入）から、信託報酬等の経費を差し引いたものをベースに決定しました。

なお、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せん。

○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

| 項 目 | 第180期 | 第181期 | 第182期 | 第183期 | 第184期 | 第185期 |
|-----------|---------------------------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|
| | 2021年12月9日～ 2022年1月11日 | 2022年1月12日～ 2022年2月8日 | 2022年2月9日～ 2022年3月8日 | 2022年3月9日～ 2022年4月8日 | 2022年4月9日～ 2022年5月9日 | 2022年5月10日～ 2022年6月8日 |
| 当期分配金 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 |
| （対基準価額比率） | 0.293% | 0.300% | 0.305% | 0.289% | 0.285% | 0.281% |
| 当期の収益 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 |
| 当期の収益以外 | — | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,451 | 2,451 | 2,451 | 2,472 | 2,491 | 2,505 |

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

<Cコース/Dコース>

○投資環境

米国ハイ・イールド債券市場は、当作成期間で下落となりました（トータルリターン・現地通貨ベース）。米国の金融政策や原油価格の動向などに左右されました。

為替市場は、日銀が金融緩和姿勢を維持する一方で、エネルギー高などによるインフレの高まりを背景にFRB（米連邦準備制度理事会）による積極的な利上げ観測が高まり、当作成期間で、ドル高・円安となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村米国好利回り社債投信 Cコース]

主要投資対象である野村米国好利回り社債投信 マザーファンド受益証券を高位に組み入れ、実質外貨建資産については為替ヘッジを活用し為替変動リスクの低減を図りました。

[野村米国好利回り社債投信 Dコース]

主要投資対象である野村米国好利回り社債投信 マザーファンド受益証券を高位に組み入れ、実質外貨建資産については為替ヘッジを行いませんでした。

[野村米国好利回り社債投信 マザーファンド]

・資産別組入比率

ハイ・イールド債券（ローン等を含む）の組み入れを高位に維持しました。

・信用格付け別組入比率

信用格付け別組入比率については、B格を中心に、BB格やCCC格など幅広く組み入れを行いました。BBB格以上、BB格、B格、CCC格以下、無格付けの組入比率は、5月末には2.0%、33.3%、40.1%、17.2%、1.6%としました。

<Cコース/Dコース>

◎今後の運用方針

[野村米国好利回り社債投信 マザーファンド]

- ・当ファンドでは個別発行体の信用力を調査・分析するボトムアップ・アプローチに基づいて運用を行なっていきます。また、ハイ・イールド債券が持つ価格下落リスクをできる限り回避しながら、高水準のインカム（利息）収入やキャピタル・ゲイン（値上がり益）の獲得を目指す方針です。
- ・米国ハイ・イールド債券市場は、米国のインフレ率の上昇、FRB（米連邦準備制度理事会）の金融引き締めへの積極的な姿勢などを背景に、不安定な推移となっています。一方で、企業や消費者のバランスシートは比較的良好な状態にあることや、中国の経済活動が再開され、企業活動が回復することで世界的な経済成長を支えとの期待が高まっていることなどを背景に、ハイ・イールド債券のデフォルト（債務不履行）率の大幅な上昇は予想されておりません。引き続き、FRBによる金融政策やバイデン米政権による財政政策を注視しながら、銘柄を選定して運用を行ないます。
- ・個別銘柄の選択にはより一層慎重に対応していきませんが、今後もキャッシュフロー（現金収支）が安定的な企業や良好な収益見通しが期待できる企業を中心に投資を行なう方針です。組み入れに当たっては、ディストレス債やデフォルト債を含むハイ・イールド債券を中心に、ローンや優先証券など幅広く投資を行なっていきます。

[野村米国好利回り社債投信 Cコース]

主要投資対象である野村米国好利回り社債投信 マザーファンド受益証券を高位に組み入れ、実質外貨建資産については為替ヘッジを活用し為替変動リスクの低減を図る方針です。

[野村米国好利回り社債投信 Dコース]

主要投資対象である野村米国好利回り社債投信 マザーファンド受益証券を高位に組み入れ、実質外貨建資産については為替ヘッジを行なわない方針です。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしく願いいたします。

<Cコース>

○1万口当たりの費用明細

(2021年12月9日～2022年6月8日)

| 項 目 | 第180期～第185期 | | 項 目 の 概 要 |
|------------------------|-------------|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 62 | 0.878 | (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 ） | (40) | (0.576) | 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 ） | (19) | (0.274) | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等 |
| （ 受 託 会 社 ） | (2) | (0.027) | 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) 売 買 委 託 手 数 料 | 0 | 0.000 | (b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.000) | |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税 | 0 | 0.000 | (c) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.000) | |
| (d) そ の 他 費 用 | 3 | 0.043 | (d) 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 |
| （ 保 管 費 用 ） | (3) | (0.041) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ 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) | (0.001) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 65 | 0.921 | |
| 作成期間の平均基準価額は、7,030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。

* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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。

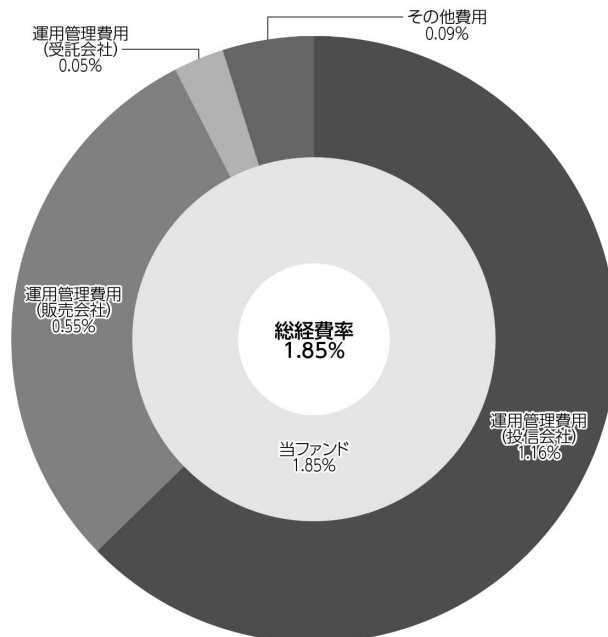
* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

<Cコース>

(参考情報)

○総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.85%です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

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

<Cコース>

○売買及び取引の状況

(2021年12月9日～2022年6月8日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 柄 | 第180期～第185期 | | | |
|----------------------|-------------|--------------|--------------|---------------|
| | 設 定 | | 解 約 | |
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 野村米国好利回り社債投信 マザーファンド | 千口 4,657 | 千円 14,500 | 千口 95,947 | 千円 295,200 |

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2021年12月9日～2022年6月8日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 第180期～第185期 | |
|----------------------|----------------------|--|
| | 野村米国好利回り社債投信 マザーファンド | |
| (a) 当作成期中の株式売買金額 | 17,515千円 | |
| (b) 当作成期中の平均組入株式時価総額 | 76,206千円 | |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.22 | |

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2021年12月9日～2022年6月8日)

該当事項はございません。

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す。

<Cコース>

○組入資産の明細

(2022年6月8日現在)

親投資信託残高

| 銘 | 柄 | 第179期末 | | 第185期末 | | |
|--------------|---------|--------|---------|--------|---------|---------|
| | | 口 | 数 | 口 | 数 | 評 価 額 |
| | | | 千口 | | 千口 | 千円 |
| 野村米国好利回り社債投信 | マザーファンド | | 383,071 | | 291,782 | 949,838 |

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年6月8日現在)

| 項 | 目 | 第185期末 | |
|--------------|---------|---------|-------|
| | | 評 価 額 | 比 率 |
| | | 千円 | % |
| 野村米国好利回り社債投信 | マザーファンド | 949,838 | 98.4 |
| コール・ローン等、その他 | | 15,027 | 1.6 |
| 投資信託財産総額 | | 964,865 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*野村米国好利回り社債投信 マザーファンドにおいて、第185期末における外貨建純資産(12,570,768千円)の投資信託財産総額(12,774,736千円)に対する比率は98.4%です。

*外貨建資産は、第185期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=132.81円。

○特定資産の価格等の調査

野村米国好利回り社債投信 マザーファンドにおいて調査依頼を行なった取引は2021年12月7日から2022年6月7日までの間で金銭債権(貸付債権)1件でした。これらの金銭債権(貸付債権)について、投資信託及び投資法人に関する法律(昭和26年法律第198号)第11条第2項に基づいて比較可能な価格のほか、金銭債権の債務者、額面、担保の設定状況、約定価格その他の当該金銭債権(貸付債権)の内容に関して、EY新日本有限責任監査法人に調査を委託し、日本公認会計士協会が公表した専門業務実務指針4460「投資信託及び投資法人における特定資産の価格等の調査に係る合意された手続業務に関する実務指針」に基づく調査結果として合意された手続実施結果報告書を入手しています。

なお、本調査は財務諸表監査の一部ではなく、また、価格の妥当性や内部管理体制について保証を提供するものではありません。

<Cコース>

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第180期末 | 第181期末 | 第182期末 | 第183期末 | 第184期末 | 第185期末 |
|------------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | 2022年1月11日現在 | 2022年2月8日現在 | 2022年3月8日現在 | 2022年4月8日現在 | 2022年5月9日現在 | 2022年6月8日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 2,295,451,467 | 2,148,762,476 | 2,059,815,112 | 1,993,940,257 | 1,884,255,753 | 1,869,944,198 |
| コール・ローン等 | 12,759,878 | 11,575,097 | 10,392,366 | 9,894,161 | 9,134,858 | 9,227,506 |
| 野村米国好利回り社債投信 マザーファンド(評価額) | 1,155,293,518 | 1,077,003,866 | 1,032,284,057 | 1,015,761,879 | 949,127,890 | 949,838,364 |
| 未収入金 | 1,127,398,071 | 1,060,183,513 | 1,017,138,689 | 968,284,217 | 925,993,005 | 910,878,328 |
| (B) 負債 | 1,140,681,833 | 1,070,021,987 | 1,056,670,683 | 1,012,554,380 | 941,421,416 | 937,009,719 |
| 未払金 | 1,132,362,040 | 1,063,983,424 | 1,011,935,975 | 1,003,295,416 | 935,693,935 | 931,408,524 |
| 未払収益分配金 | 4,729,850 | 4,529,978 | 4,289,084 | 4,272,430 | 4,278,598 | 4,249,269 |
| 未払解約金 | 1,673,473 | — | 39,012,166 | 3,496,000 | — | — |
| 未払信託報酬 | 1,914,086 | 1,506,706 | 1,431,674 | 1,488,682 | 1,447,080 | 1,350,242 |
| 未払利息 | 1 | 5 | 1 | 1 | 3 | 5 |
| その他未払費用 | 2,383 | 1,874 | 1,783 | 1,851 | 1,800 | 1,679 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,154,769,634 | 1,078,740,489 | 1,003,144,429 | 981,385,877 | 942,834,337 | 932,934,479 |
| 元本 | 1,576,616,812 | 1,509,992,903 | 1,429,694,720 | 1,424,143,475 | 1,426,199,441 | 1,416,423,081 |
| 次期繰越損益金 | △ 421,847,178 | △ 431,252,414 | △ 426,550,291 | △ 442,757,598 | △ 483,365,104 | △ 483,488,602 |
| (D) 受益権総口数 | 1,576,616,812口 | 1,509,992,903口 | 1,429,694,720口 | 1,424,143,475口 | 1,426,199,441口 | 1,416,423,081口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 7.324円 | 7.144円 | 7.016円 | 6.891円 | 6.611円 | 6.587円 |

(注) 第180期首元本額は1,579,718,243円、第180～185期中追加設定元本額は20,299,727円、第180～185期中一部解約元本額は183,594,889円、1口当たり純資産額は、第180期0.7324円、第181期0.7144円、第182期0.7016円、第183期0.6891円、第184期0.6611円、第185期0.6587円です。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額37,137,240円。(野村米国好利回り社債投信 マザーファンド)

<Cコース>

○損益の状況

| 項 目 | 第180期 | 第181期 | 第182期 | 第183期 | 第184期 | 第185期 |
|------------------|---------------------------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|
| | 2021年12月9日～ 2022年1月11日 | 2022年1月12日～ 2022年2月8日 | 2022年2月9日～ 2022年3月8日 | 2022年3月9日～ 2022年4月8日 | 2022年4月9日～ 2022年5月9日 | 2022年5月10日～ 2022年6月8日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 169 | △ 162 | △ 116 | △ 31 | △ 180 | △ 87 |
| 支払利息 | △ 169 | △ 162 | △ 116 | △ 31 | △ 180 | △ 87 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 4,515,128 | △ 21,173,001 | △ 12,508,889 | △ 12,100,425 | △ 34,200,913 | 2,164,279 |
| 売買益 | 14,160,413 | 12,871,287 | 9,917,769 | 58,124,371 | 65,381,776 | 33,854,114 |
| 売買損 | △ 18,675,541 | △ 34,044,288 | △ 22,426,658 | △ 70,224,796 | △ 99,582,689 | △ 31,689,835 |
| (C) 信託報酬等 | △ 1,916,469 | △ 1,508,580 | △ 1,433,457 | △ 1,490,533 | △ 1,448,880 | △ 1,351,921 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 6,431,766 | △ 22,681,743 | △ 13,942,462 | △ 13,590,989 | △ 35,649,973 | 812,271 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 81,207,668 | △ 88,266,108 | △ 109,253,510 | △ 126,895,649 | △ 144,327,935 | △ 182,854,681 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 329,477,894 | △ 315,774,585 | △ 299,065,235 | △ 297,998,530 | △ 299,108,598 | △ 297,196,923 |
| (配当等相当額) | (588,541,347) | (563,756,238) | (533,800,847) | (531,750,293) | (532,634,025) | (529,015,565) |
| (売買損益相当額) | (△918,019,241) | (△879,530,823) | (△832,866,082) | (△829,748,823) | (△831,742,623) | (△826,212,488) |
| (G) 計(D+E+F) | △ 417,117,328 | △ 426,722,436 | △ 422,261,207 | △ 438,485,168 | △ 479,086,506 | △ 479,239,333 |
| (H) 収益分配金 | △ 4,729,850 | △ 4,529,978 | △ 4,289,084 | △ 4,272,430 | △ 4,278,598 | △ 4,249,269 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △ 421,847,178 | △ 431,252,414 | △ 426,550,291 | △ 442,757,598 | △ 483,365,104 | △ 483,488,602 |
| 追加信託差損益金 | △ 329,477,894 | △ 315,774,585 | △ 299,065,235 | △ 297,998,530 | △ 299,108,598 | △ 297,196,923 |
| (配当等相当額) | (588,557,343) | (563,760,098) | (533,803,381) | (531,751,986) | (532,648,057) | (529,016,751) |
| (売買損益相当額) | (△918,035,237) | (△879,534,683) | (△832,868,616) | (△829,750,516) | (△831,756,655) | (△826,213,674) |
| 分配準備積立金 | 31,966,896 | 29,356,860 | 26,589,621 | 25,862,006 | 24,979,526 | 23,385,864 |
| 繰越損益金 | △ 124,336,180 | △ 144,834,689 | △ 154,074,677 | △ 170,621,074 | △ 209,236,032 | △ 209,677,543 |

* 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(2021年12月9日～2022年6月8日)は以下の通りです。

| 項 目 | 第180期 | 第181期 | 第182期 | 第183期 | 第184期 | 第185期 |
|------------------------------|---------------------------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|
| | 2021年12月9日～ 2022年1月11日 | 2022年1月12日～ 2022年2月8日 | 2022年2月9日～ 2022年3月8日 | 2022年3月9日～ 2022年4月8日 | 2022年4月9日～ 2022年5月9日 | 2022年5月10日～ 2022年6月8日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 4,379,074円 | 3,339,958円 | 3,104,196円 | 3,667,749円 | 3,473,141円 | 2,845,652円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越大損金補填後) | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 588,557,343円 | 563,760,098円 | 533,803,381円 | 531,751,986円 | 532,648,057円 | 529,016,751円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 32,317,672円 | 30,546,880円 | 27,774,509円 | 26,466,687円 | 25,784,983円 | 24,789,481円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 625,254,089円 | 597,646,936円 | 564,682,086円 | 561,886,422円 | 561,906,181円 | 556,651,884円 |
| f. 分配対象収益(1万円当たり) | 3,965円 | 3,957円 | 3,949円 | 3,945円 | 3,939円 | 3,929円 |
| g. 分配金 | 4,729,850円 | 4,529,978円 | 4,289,084円 | 4,272,430円 | 4,278,598円 | 4,249,269円 |
| h. 分配金(1万円当たり) | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 |

<Cコース>

○分配金のお知らせ

| | 第180期 | 第181期 | 第182期 | 第183期 | 第184期 | 第185期 |
|------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 1 万口当たり分配金 (税込み) | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30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。

<Dコース>

○1万口当たりの費用明細

(2021年12月9日～2022年6月8日)

| 項 目 | 第180期～第185期 | | 項 目 の 概 要 |
|-------------------------|-------------|-----------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 90 | 0.878 | (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) | (59) | (0.576) | 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) | (28) | (0.274) | 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) | (3) | (0.027) | 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) 売 買 委 託 手 数 料 | 0 | 0.000 | (b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (株 式) | (0) | (0.000) | |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税 | 0 | 0.000 | (c) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株 式) | (0) | (0.000) | |
| (d) そ の 他 費 用 | 4 | 0.040 | (d) 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 |
| (保 管 費 用) | (4) | (0.040) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (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) | (△0.001) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 94 | 0.918 | |
| 作成期間の平均基準価額は、10,273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。

* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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。

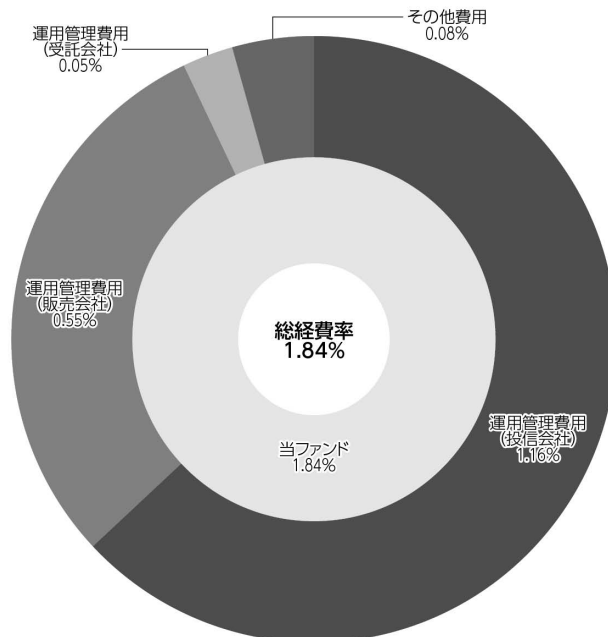
* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

<Dコース>

(参考情報)

○総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.84%です。



(注) 当ファンドの費用は1万円当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

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

<Dコース>

○売買及び取引の状況

(2021年12月9日～2022年6月8日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 柄 | 第180期～第185期 | | | |
|----------------------|-------------|---------|---------------|---------------|
| | 設 定 | | 解 約 | |
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 野村米国好利回り社債投信 マザーファンド | 千口 — | 千円 — | 千口 150,596 | 千円 465,400 |

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2021年12月9日～2022年6月8日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 第180期～第185期 | |
|----------------------|----------------------|--|
| | 野村米国好利回り社債投信 マザーファンド | |
| (a) 当作成期中の株式売買金額 | 17,515千円 | |
| (b) 当作成期中の平均組入株式時価総額 | 76,206千円 | |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.22 | |

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2021年12月9日～2022年6月8日)

該当事項はございません。

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す。

<Dコース>

○組入資産の明細

(2022年6月8日現在)

親投資信託残高

| 銘 | 柄 | 第179期末 | | 第185期末 | |
|--------------|---------|--------|-------------|--------|-------------|
| | | 口 | 数 | 口 | 数 |
| | | | 千円 | | 千円 |
| 野村米国好利回り社債投信 | マザーファンド | | 2, 479, 111 | | 2, 328, 515 |
| | | | | | 7, 580, 015 |

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年6月8日現在)

| 項 | 目 | 第185期末 | |
|--------------|---------|-------------|--------|
| | | 評 価 額 | 比 率 |
| | | 千円 | % |
| 野村米国好利回り社債投信 | マザーファンド | 7, 580, 015 | 98. 6 |
| コール・ローン等、その他 | | 109, 560 | 1. 4 |
| 投資信託財産総額 | | 7, 689, 575 | 100. 0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*野村米国好利回り社債投信 マザーファンドにおいて、第185期末における外貨建純資産(12, 570, 768千円)の投資信託財産総額(12, 774, 736千円)に対する比率は98. 4%です。

*外貨建資産は、第185期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=132. 81円。

○特定資産の価格等の調査

野村米国好利回り社債投信 マザーファンドにおいて調査依頼を行なった取引は2021年12月7日から2022年6月7日までの間で金銭債権(貸付債権)1件でした。これらの金銭債権(貸付債権)について、投資信託及び投資法人に関する法律(昭和26年法律第198号)第11条第2項に基づいて比較可能な価格のほか、金銭債権の債務者、額面、担保の設定状況、約定価格その他の当該金銭債権(貸付債権)の内容に関して、EY新日本有限責任監査法人に調査を委託し、日本公認会計士協会が公表した専門業務実務指針4460「投資信託及び投資法人における特定資産の価格等の調査に係る合意された手続業務に関する実務指針」に基づく調査結果として合意された手続実施結果報告書を入手しています。

なお、本調査は財務諸表監査の一部ではなく、また、価格の妥当性や内部管理体制について保証を提供するものではありません。

<Dコース>

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第180期末 | 第181期末 | 第182期末 | 第183期末 | 第184期末 | 第185期末 |
|------------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | 2022年1月11日現在 | 2022年2月8日現在 | 2022年3月8日現在 | 2022年4月8日現在 | 2022年5月9日現在 | 2022年6月8日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 7,579,437,986 | 7,363,133,847 | 7,210,204,929 | 7,539,167,081 | 7,636,168,215 | 7,689,575,169 |
| コール・ローン等 | 72,527,769 | 73,222,489 | 72,923,012 | 75,061,163 | 103,051,537 | 79,759,401 |
| 野村米国好利回り社債投信 マザーファンド(評価額) | 7,467,810,217 | 7,212,011,358 | 7,105,781,917 | 7,429,405,918 | 7,523,116,678 | 7,580,015,768 |
| 未収入金 | 39,100,000 | 77,900,000 | 31,500,000 | 34,700,000 | 10,000,000 | 29,800,000 |
| (B) 負債 | 59,409,093 | 77,822,933 | 32,800,653 | 34,756,152 | 36,215,195 | 40,512,406 |
| 未払収益分配金 | 22,104,392 | 21,934,344 | 21,929,786 | 21,765,326 | 21,720,853 | 21,543,548 |
| 未払解約金 | 24,840,738 | 45,848,571 | 1,091,919 | 1,931,325 | 3,092,453 | 8,208,442 |
| 未払信託報酬 | 12,448,403 | 10,027,458 | 9,766,739 | 11,045,695 | 11,387,625 | 10,746,943 |
| 未払利息 | 10 | 37 | 10 | 9 | 40 | 49 |
| その他未払費用 | 15,550 | 12,523 | 12,199 | 13,797 | 14,224 | 13,424 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 7,520,028,893 | 7,285,310,914 | 7,177,404,276 | 7,504,410,929 | 7,599,953,020 | 7,649,062,763 |
| 元本 | 7,368,130,724 | 7,311,448,175 | 7,309,928,688 | 7,255,108,949 | 7,240,284,415 | 7,181,182,672 |
| 次期繰越損益金 | 151,898,169 | △ 26,137,261 | △ 132,524,412 | 249,301,980 | 359,668,605 | 467,880,091 |
| (D) 受益権総口数 | 7,368,130,724口 | 7,311,448,175口 | 7,309,928,688口 | 7,255,108,949口 | 7,240,284,415口 | 7,181,182,672口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,206円 | 9,964円 | 9,819円 | 10,344円 | 10,497円 | 10,652円 |

(注) 第180期元本額は7,445,171,619円、第180～185期中追加設定元本額は50,740,365円、第180～185期中一部解約元本額は314,729,312円、1口当たり純資産額は、第180期1.0206円、第181期0.9964円、第182期0.9819円、第183期1.0344円、第184期1.0497円、第185期1.0652円です。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額37,137,240円。(野村米国好利回り社債投信 マザーファンド)

<Dコース>

○損益の状況

| 項 目 | 第180期 | 第181期 | 第182期 | 第183期 | 第184期 | 第185期 |
|------------------|---------------------------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|
| | 2021年12月9日～ 2022年1月11日 | 2022年1月12日～ 2022年2月8日 | 2022年2月9日～ 2022年3月8日 | 2022年3月9日～ 2022年4月8日 | 2022年4月9日～ 2022年5月9日 | 2022年5月10日～ 2022年6月8日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 1,116 | △ 1,030 | △ 870 | △ 294 | △ 819 | △ 812 |
| 支払利息 | △ 1,116 | △ 1,030 | △ 870 | △ 294 | △ 819 | △ 812 |
| (B) 有価証券売買損益 | 90,597,346 | △ 144,889,524 | △ 74,682,114 | 413,655,779 | 143,590,725 | 143,682,759 |
| 売買益 | 91,618,614 | 850,433 | 44,487 | 416,125,982 | 144,510,675 | 145,562,395 |
| 売買損 | △ 1,021,268 | △ 145,739,957 | △ 74,726,601 | △ 2,470,203 | △ 919,950 | △ 1,879,636 |
| (C) 信託報酬等 | △ 12,463,953 | △ 10,039,981 | △ 9,778,938 | △ 11,059,492 | △ 11,401,849 | △ 10,760,367 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 78,132,277 | △ 154,930,535 | △ 84,461,922 | 402,595,993 | 132,188,057 | 132,921,580 |
| (E) 前期繰越損益金 | 322,814,926 | 375,804,430 | 198,837,829 | 91,724,304 | 469,684,488 | 574,470,271 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 226,944,642 | △ 225,076,812 | △ 224,970,533 | △ 223,252,991 | △ 220,483,087 | △ 217,968,212 |
| (配当等相当額) | (272,966,781) | (271,378,641) | (271,787,172) | (270,224,798) | (275,819,554) | (276,159,524) |
| (売買損益相当額) | (△ 499,911,423) | (△ 496,455,453) | (△ 496,757,705) | (△ 493,477,789) | (△ 496,302,641) | (△ 494,127,736) |
| (G) 計(D+E+F) | 174,002,561 | △ 4,202,917 | △ 110,594,626 | 271,067,306 | 381,389,458 | 489,423,639 |
| (H) 収益分配金 | △ 22,104,392 | △ 21,934,344 | △ 21,929,786 | △ 21,765,326 | △ 21,720,853 | △ 21,543,548 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 151,898,169 | △ 26,137,261 | △ 132,524,412 | 249,301,980 | 359,668,605 | 467,880,091 |
| 追加信託差損益金 | △ 226,944,642 | △ 225,076,812 | △ 224,970,533 | △ 223,252,991 | △ 220,483,087 | △ 217,968,212 |
| (配当等相当額) | (272,976,640) | (271,381,953) | (271,794,007) | (270,230,008) | (275,920,492) | (276,178,981) |
| (売買損益相当額) | (△ 499,921,282) | (△ 496,458,765) | (△ 496,764,540) | (△ 493,482,999) | (△ 496,403,579) | (△ 494,147,193) |
| 分配準備積立金 | 1,533,425,151 | 1,521,165,435 | 1,520,482,268 | 1,523,529,406 | 1,528,343,980 | 1,522,772,835 |
| 繰越損益金 | △1,154,582,340 | △1,322,225,884 | △1,428,036,147 | △1,050,974,435 | △ 948,192,288 | △ 836,924,532 |

* 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(2021年12月9日～2022年6月8日)は以下の通りです。

| 項 目 | 第180期 | 第181期 | 第182期 | 第183期 | 第184期 | 第185期 |
|------------------------------|---------------------------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|
| | 2021年12月9日～ 2022年1月11日 | 2022年1月12日～ 2022年2月8日 | 2022年2月9日～ 2022年3月8日 | 2022年3月9日～ 2022年4月8日 | 2022年4月9日～ 2022年5月9日 | 2022年5月10日～ 2022年6月8日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 34,995,883円 | 21,972,955円 | 22,024,407円 | 36,684,302円 | 35,789,933円 | 30,939,466円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越大損金補填後) | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 272,976,640円 | 271,381,953円 | 271,794,007円 | 270,230,008円 | 275,920,492円 | 276,178,981円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 1,520,533,660円 | 1,521,126,824円 | 1,520,387,647円 | 1,508,610,430円 | 1,514,274,900円 | 1,513,376,917円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 1,828,506,183円 | 1,814,481,732円 | 1,814,206,061円 | 1,815,524,740円 | 1,825,985,325円 | 1,820,495,364円 |
| f. 分配対象収益(1万円当たり) | 2,481円 | 2,481円 | 2,481円 | 2,502円 | 2,521円 | 2,535円 |
| g. 分配金 | 22,104,392円 | 21,934,344円 | 21,929,786円 | 21,765,326円 | 21,720,853円 | 21,543,548円 |
| h. 分配金(1万円当たり) | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 |

<Dコース>

○分配金のお知らせ

| | 第180期 | 第181期 | 第182期 | 第183期 | 第184期 | 第185期 |
|------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 1 万口当たり分配金 (税込み) | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30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

(2022年6月8日現在)

<野村米国好利回り社債投信 マザーファンド>

下記は、野村米国好利回り社債投信 マザーファンド全体（3,891,796千口）の内容です。

外国株式

| 銘柄 | 第179期末 | | 第185期末 | | 業 種 等 |
|---------------------------------------|--------------|-------|---------|--------|--------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| BLUESTEM GROUP INC | 113 | 113 | 17 | 2,259 | インターネット販売・通信販売 |
| CALIFORNIA RESOURCES CORP | 0.8 | 0.8 | 3 | 508 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CLOUD PEAK ENERGY INC | 0.59 | 0.59 | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| DIRECTBUY HOLDINGS INC | 27 | 27 | — | — | 専門小売り |
| FTS INTERNATIONAL INC-CL A | 42 | — | — | — | エネルギー設備・サービス |
| FERRELLGAS PARTNERS LP-B | 1 | — | — | — | ガス |
| GULFPORT ENERGY CORP | 24 | 17 | 191 | 25,370 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HEXION HOLDINGS CORP -B | 109 | — | — | — | 化学 |
| IHEARTMEDIA INC-CLASS A | — | 7 | 8 | 1,123 | メディア |
| NEENAH ENTERPRISES INC | 1,077 | 1,077 | — | — | 金属・鉱業 |
| PARKER DRILLING CO-POST BANK | 9 | 9 | 6 | 835 | エネルギー設備・サービス |
| UC HOLDINGS INC | 68 | 68 | 54 | 7,251 | 自動車部品 |
| VISTRA CORP | 33 | 33 | 90 | 12,051 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| HERCULES OFFSHORE ESCROW COM | 119 | — | — | — | エネルギー設備・サービス |
| WARREN RESOURCES INC | 36 | 36 | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| VISTRA CORP RIGHTS | 38 | 38 | 4 | 639 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| NINE POINT ENERGY HOLDINGS-PFD | 0.46 | 0.46 | 1 | 152 | エネルギー設備・サービス |
| NINE POINT ENERGY HOLDINGS COMMON | 27 | 27 | 0.67675 | 89 | エネルギー設備・サービス |
| SUNGARD MEMBERSHIP INTEREST | 3 | 3 | 2 | 304 | 電力 |
| GATEWAY CASINO LIMITED COMMON STOCK | 1,408 | 1,408 | — | — | ホテル・レストラン・レジャー |
| BRUIN BLOCKER LLC COM | 152 | 152 | 0.175 | 23 | エネルギー設備・サービス |
| GULFPORT ENERGY PFD | 0.06 | 0.06 | 41 | 5,498 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HARDWOODS HOLDINGS COM | 4 | 4 | 39 | 5,221 | 建設 |
| INTELSAT SA/LUXEMBOURG COMMON | — | 16 | 50 | 6,681 | 通信 |
| INTELSAT JACKSON HOLDING LU2445091858 | — | 1 | 0.783 | 103 | 通信 |
| INTELSAT JACKSON HOLDING LU2445092583 | — | 1 | 0.7395 | 98 | 通信 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | — | 1 | 13 | 1,759 | 化学 |
| 合 計 | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 | |
| | 3,301 | 3,050 | 22 | 526 | 69,973 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | | 22 | — | < 0.6% > |

* 邦貨換算金額は、第185期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 邦貨換算金額欄の〈 〉内は、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各国別株式評価額の比率。

* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

外国新株予約権証券

| 銘柄 | 第179期末 証券数 | 第185期末 | | | |
|--|---------------|---------|---------|--------|--------|
| | | 証券数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 証券 | 証券 | 千米ドル | 千円 | |
| CWT TRAVEL HOLDINGS-A-CW26 | — | 1,052 | — | — | |
| CWT TRAVEL HOLDINGS-B-CW28 | — | 1,108 | — | — | |
| CALIFORNIA RESOURCES WARRANT | 133 | 133 | 2 | 287 | |
| DENBURY-CW25 09/18/25 | 875 | 875 | 43 | 5,769 | |
| IHEARTMEDIA INC-CLASS A CW39 | 755 | — | — | — | |
| IPAYMENT HOLDINGS INC WARRANT 12/29/2022 | 836,360 | 836,360 | — | — | |
| VISTRA CORP - CW24 | 1,823 | 1,823 | 0.56513 | 75 | |
| INTELSAT SA/LUXEMBOURG WARRANT | — | 1 | 0.0025 | 0.332 | |
| APPVION CORP WRT US03835B1263 | 341 | — | — | — | |
| APPVION CORP WRT US03835B1180 | 341 | — | — | — | |
| 計 | 証券数・金額 | 840,628 | 841,352 | 46 | 6,133 |
| | 銘柄数<比率> | 7 | 7 | — | <0.0%> |

* 邦貨換算金額は、第185期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* <>内は、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比率。

* 金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区分 | 第185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 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| アメリカ | 132,380 | 89,680 | 11,910,521 | 94.0 | 91.2 | 59.8 | 31.1 | 3.1 |
| 合計 | 132,380 | 89,680 | 11,910,521 | 94.0 | 91.2 | 59.8 | 31.1 | 3.1 |

* 邦貨換算金額は、第185期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 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、価格情報会社よりデータを入手しています。

* S&Pグローバル・レーティング、ムーディーズ・インベスターズ・サービスによる格付けを採用しています。なお、無格付けが0.9%あります。

(B) 外国(外貨建) 公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | | 第185期末 | | | | | 償還年月日 |
|---------------------|--------------------------|--------|-------|-------|--------|------------|-------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 1011778 BC / NEW RED FIN | 4.375 | 150 | 138 | 18,363 | 2028/1/15 | |
| | 1839688 ALBERTA ULC | — | 181 | — | — | 2023/2/13 | |
| | ACRISURE LLC / FIN INC | 7.0 | 200 | 195 | 25,925 | 2025/11/15 | |
| | ACRISURE LLC / FIN INC | 10.125 | 75 | 76 | 10,170 | 2026/8/1 | |
| | ACRISURE LLC / FIN INC | 4.25 | 125 | 109 | 14,550 | 2029/2/15 | |
| | ADAMS HOMES INC | 7.5 | 75 | 73 | 9,705 | 2025/2/15 | |
| | ADT SEC CORP | 4.125 | 100 | 88 | 11,714 | 2029/8/1 | |
| | ADVANCED DRAINAGE SYSTEM | 6.375 | 50 | 50 | 6,716 | 2030/6/15 | |
| | AETHON UN/AETHIN UN FIN | 8.25 | 150 | 151 | 20,079 | 2026/2/15 | |
| | AFFINITY GAMING | 6.875 | 125 | 110 | 14,699 | 2027/12/15 | |
| | AG ISSUER LLC | 6.25 | 125 | 118 | 15,767 | 2028/3/1 | |
| | AHERN RENTALS INC | 7.375 | 275 | 240 | 31,958 | 2023/5/15 | |
| | AHP HEALTH PARTN | 5.75 | 50 | 39 | 5,188 | 2029/7/15 | |
| | AIR CANADA | 3.875 | 225 | 207 | 27,526 | 2026/8/15 | |
| | ALBERTSONS COS/SAFEWAY | 4.625 | 100 | 95 | 12,619 | 2027/1/15 | |
| | ALBERTSONS COS/SAFEWAY | 3.5 | 100 | 85 | 11,329 | 2029/3/15 | |
| | ALBERTSONS COS/SAFEWAY | 4.875 | 100 | 91 | 12,148 | 2030/2/15 | |
| | ALLEGHENY TECHNOLOGIES | 4.875 | 125 | 113 | 15,045 | 2029/10/1 | |
| | ALLEGHENY TECHNOLOGIES | 5.125 | 25 | 22 | 2,988 | 2031/10/1 | |
| | ALLEN MEDIA LLC/CO-ISSR | 10.5 | 150 | 93 | 12,366 | 2028/2/15 | |
| | ALLIED UNIVERSAL HOLDCO | 6.625 | 150 | 147 | 19,626 | 2026/7/15 | |
| | ALLIED UNIVERSAL HOLDCO | 9.75 | 250 | 231 | 30,769 | 2027/7/15 | |
| | ALTICE FINANCING SA | 5.0 | 200 | 173 | 22,996 | 2028/1/15 | |
| | ALTICE FRANCE HOLDING SA | 10.5 | 400 | 388 | 51,578 | 2027/5/15 | |
| | ALTICE FRANCE HOLDING SA | 6.0 | 200 | 162 | 21,517 | 2028/2/15 | |
| | ALTICE FRANCE SA | 5.125 | 275 | 226 | 30,145 | 2029/7/15 | |
| | ALTICE FRANCE SA | 5.5 | 200 | 167 | 22,302 | 2029/10/15 | |
| | ALTOS ESCROW DEBT | 11.375 | 1,675 | — | — | 2002/4/30 | |
| | ALTOS ESCROW DEBT | 11.875 | 4,010 | — | — | 2004/4/30 | |
| | AMC ENTERTAINMENT HOLDIN | 10.0 | 264 | 196 | 26,106 | 2026/6/15 | |
| | AMERICAN AIRLINES INC | 11.75 | 275 | 307 | 40,814 | 2025/7/15 | |
| | AMERICAN AIRLINES/AADVAN | 5.5 | 100 | 97 | 12,901 | 2026/4/20 | |
| | AMERICAN AIRLINES/AADVAN | 5.75 | 100 | 94 | 12,484 | 2029/4/20 | |
| | AMN HEALTHCARE INC | 4.625 | 100 | 96 | 12,804 | 2027/10/1 | |
| | AMN HEALTHCARE INC | 4.0 | 325 | 293 | 39,031 | 2029/4/15 | |
| | AMS AG | 7.0 | 200 | 198 | 26,387 | 2025/7/31 | |
| | APACHE CORP | 4.25 | 100 | 95 | 12,739 | 2030/1/15 | |
| | APACHE CORP | 4.75 | 75 | 63 | 8,484 | 2043/4/15 | |
| | APPVION ESCROW | — | 350 | — | — | 2022/6/1 | |
| | ARCHES BUYER INC | 4.25 | 100 | 90 | 11,973 | 2028/6/1 | |
| | ARCHROCK PARTNERS LP/FIN | 6.875 | 125 | 123 | 16,381 | 2027/4/1 | |
| | ARCHROCK PARTNERS LP/FIN | 6.25 | 200 | 192 | 25,545 | 2028/4/1 | |
| | ARCONIC INC | 5.9 | 100 | 104 | 13,829 | 2027/2/1 | |
| | ARD FINANCE SA | 6.5 | 200 | 157 | 20,964 | 2027/6/30 | |
| | ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA | 5.25 | 400 | 328 | 43,563 | 2027/8/15 | |

| 銘柄 | 銘柄 | 第185期末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|--------|-------|--------|--------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | ARKO CORP | 5.125 | 50 | 42 | 5,583 | 2029/11/15 |
| | ASCENT RESOURCES/ARU FIN | 9.0 | 61 | 82 | 10,902 | 2027/11/1 |
| | ASCENT RESOURCES/ARU FIN | 8.25 | 100 | 101 | 13,495 | 2028/12/31 |
| | ASHTON WOODS USA/FINANCE | 6.625 | 75 | 70 | 9,394 | 2028/1/15 |
| | ASHTON WOODS USA/FINANCE | 4.625 | 75 | 63 | 8,437 | 2029/8/1 |
| | ASHTON WOODS USA/FINANCE | 4.625 | 75 | 62 | 8,362 | 2030/4/1 |
| | ASP AMC MERGER SUB | 8.0 | 100 | 72 | 9,587 | 2025/5/15 |
| | ASSUREDPARTNERS INC | 7.0 | 300 | 296 | 39,389 | 2025/8/15 |
| | ASSUREDPARTNERS INC | 5.625 | 50 | 43 | 5,745 | 2029/1/15 |
| | ATLANTICA SUSTAIN INFRA | 4.125 | 200 | 183 | 24,333 | 2028/6/15 |
| | ATLAS LUXCO 4 / ALL UNI | 4.625 | 200 | 176 | 23,494 | 2028/6/1 |
| | AUSTIN BIDCO INC | 7.125 | 425 | 358 | 47,624 | 2028/12/15 |
| | AVANTOR FUNDING INC | 4.625 | 50 | 47 | 6,280 | 2028/7/15 |
| | AVANTOR FUNDING INC | 3.875 | 200 | 180 | 23,956 | 2029/11/1 |
| | AVENTINE ENERGY ESCROW | — | 2,850 | — | — | 2017/4/1 |
| | AVIS BUDGET CAR/FINANCE | 4.75 | 175 | 156 | 20,774 | 2028/4/1 |
| | AVIS BUDGET CAR/FINANCE | 5.375 | 100 | 90 | 12,050 | 2029/3/1 |
| | BAFFINLAND IRON CORP/LP | 8.75 | 200 | 181 | 24,065 | 2026/7/15 |
| | BASIC ENERGY SERVICES | — | 50 | 0.0005 | 0.066 | 2023/10/15 |
| | BAUSCH HEALTH AMERICAS | 8.5 | 75 | 59 | 7,959 | 2027/1/31 |
| | BAUSCH HEALTH COS INC | 6.125 | 75 | 69 | 9,163 | 2027/2/1 |
| | BAUSCH HEALTH COS INC | 5.0 | 225 | 145 | 19,360 | 2028/1/30 |
| | BAUSCH HEALTH COS INC | 5.0 | 175 | 108 | 14,447 | 2029/2/15 |
| | BCPE ULYSSES INTERMEDIAT | 7.75 | 75 | 62 | 8,276 | 2027/4/1 |
| | BEAZER HOMES USA | 7.25 | 100 | 92 | 12,306 | 2029/10/15 |
| | BIG RIVER STEEL/BRIS FIN | 6.625 | 200 | 200 | 26,576 | 2029/1/31 |
| | BLACKSTONE MORTGAGE TR | 3.75 | 425 | 386 | 51,289 | 2027/1/15 |
| | BOMBARDIER INC | 7.5 | 240 | 231 | 30,684 | 2024/12/1 |
| | BOMBARDIER INC | 6.0 | 100 | 83 | 11,129 | 2028/2/15 |
| | BOYD GAMING CORP | 4.75 | 225 | 201 | 26,770 | 2031/6/15 |
| | BRAND ENERGY & INFRASTRU | 8.5 | 275 | 223 | 29,636 | 2025/7/15 |
| | BRISTOW GROUP INC | 6.875 | 200 | 190 | 25,343 | 2028/3/1 |
| | BROOKFIELD PPTY REIT INC | 4.5 | 100 | 91 | 12,126 | 2027/4/1 |
| | BUFFALO THUNDER DEV 144A | — | 1,052 | 536 | 71,256 | 2022/12/9 |
| | BUFFALO THUNDER DEV 144A | — | 466 | — | — | 2099/12/15 |
| | BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 5.0 | 100 | 93 | 12,425 | 2030/3/1 |
| | BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 4.25 | 325 | 282 | 37,510 | 2032/2/1 |
| | BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 6.375 | 75 | 74 | 9,920 | 2032/6/15 |
| | CAESARS ENTERTAIN INC | 4.625 | 275 | 232 | 30,942 | 2029/10/15 |
| | CALLON PETROLEUM | 8.0 | 100 | 103 | 13,796 | 2028/8/1 |
| | CALLON PETROLEUM CO | 6.375 | 75 | 71 | 9,516 | 2026/7/1 |
| | CALPINE CORP | 5.125 | 125 | 114 | 15,206 | 2028/3/15 |
| | CALPINE CORP | 4.625 | 75 | 65 | 8,683 | 2029/2/1 |
| | CAMELOT FINANCE SA | 4.5 | 175 | 165 | 21,990 | 2026/11/1 |
| | CARLYLE AVIATION ELEVATE | 7.0 | 400 | 330 | 43,889 | 2024/10/15 |
| | CARNIVAL CORP | 10.5 | 150 | 161 | 21,437 | 2026/2/1 |
| | CARNIVAL CORP | 7.625 | 100 | 91 | 12,202 | 2026/3/1 |

| 銘柄 | 柄 | 第185期末 | | | | | 償還年月日 |
|------------------------|--------------------------|---------------|------|--------|------------|------------|----------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | CARNIVAL CORP | 5.75 | 1,325 | 1,139 | 151,366 | 2027/3/1 |
| | CARNIVAL CORP | 9.875 | 175 | 184 | 24,440 | 2027/8/1 | |
| | CARNIVAL CORP | 4.0 | 125 | 111 | 14,751 | 2028/8/1 | |
| | CARNIVAL CORP | 6.0 | 100 | 82 | 10,975 | 2029/5/1 | |
| | CARROLS RESTAURA | 5.875 | 50 | 38 | 5,097 | 2029/7/1 | |
| | CASTLE US HOLDING CORP | 9.5 | 250 | 221 | 29,403 | 2028/2/15 | |
| | CASTLELAKE AVIATION FIN | 5.0 | 275 | 235 | 31,237 | 2027/4/15 | |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 5.375 | 25 | 23 | 3,112 | 2029/6/1 | |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.75 | 250 | 222 | 29,602 | 2030/3/1 | |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.5 | 450 | 391 | 51,995 | 2030/8/15 | |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.25 | 100 | 84 | 11,258 | 2031/2/1 | |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.75 | 125 | 107 | 14,302 | 2032/2/1 | |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.5 | 725 | 609 | 80,962 | 2032/5/1 | |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.5 | 75 | 62 | 8,253 | 2033/6/1 | |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.25 | 250 | 200 | 26,571 | 2034/1/15 | |
| | CDI ESCROW ISSUER INC | 5.75 | 100 | 96 | 12,832 | 2030/4/1 | |
| | CDW LLC/CDW FINANCE | 4.25 | 75 | 70 | 9,378 | 2028/4/1 | |
| | CEMEX SAB DE CV | 5.45 | 200 | 192 | 25,534 | 2029/11/19 | |
| | CEMEX SAB DE CV | 3.875 | 200 | 167 | 22,257 | 2031/7/11 | |
| | CENTENE CORP | 4.25 | 50 | 48 | 6,433 | 2027/12/15 | |
| | CENTENE CORP | 4.625 | 100 | 95 | 12,735 | 2029/12/15 | |
| | CENTENE CORP | 3.375 | 225 | 198 | 26,321 | 2030/2/15 | |
| | CENTENE CORP | 3.0 | 325 | 278 | 37,037 | 2030/10/15 | |
| | CENTURYLINK INC | 5.125 | 225 | 202 | 26,885 | 2026/12/15 | |
| | CHENIERE ENERGY INC | 4.625 | 250 | 240 | 31,918 | 2028/10/15 | |
| | CHENIERE ENERGY PARTNERS | 4.5 | 200 | 188 | 25,016 | 2029/10/1 | |
| | CHENIERE ENERGY PARTNERS | 4.0 | 250 | 225 | 30,008 | 2031/3/1 | |
| | CHENIERE ENERGY PARTNERS | 3.25 | 200 | 170 | 22,709 | 2032/1/31 | |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 8.0 | 225 | 225 | 29,918 | 2026/3/15 | |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 5.625 | 100 | 94 | 12,585 | 2027/3/15 | |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 8.0 | 215 | 214 | 28,474 | 2027/12/15 | |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 6.0 | 75 | 69 | 9,201 | 2029/1/15 | |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 6.875 | 150 | 120 | 15,943 | 2029/4/15 | |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 6.125 | 200 | 147 | 19,580 | 2030/4/1 | |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 5.25 | 150 | 128 | 17,124 | 2030/5/15 | |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 4.75 | 182 | 149 | 19,901 | 2031/2/15 | |
| | CIENA CORP | 4.0 | 125 | 113 | 15,078 | 2030/1/31 | |
| | CINEMARK USA INC | 5.875 | 125 | 117 | 15,600 | 2026/3/15 | |
| | CINEMARK USA INC | 5.25 | 75 | 65 | 8,676 | 2028/7/15 | |
| | CITGO HOLDING INC | 9.25 | 350 | 350 | 46,539 | 2024/8/1 | |
| CITGO PETROLEUM CORP | 7.0 | 175 | 174 | 23,165 | 2025/6/15 | | |
| CITGO PETROLEUM CORP | 6.375 | 150 | 148 | 19,697 | 2026/6/15 | | |
| CITIGROUP INC | 5.35 | 25 | 24 | 3,204 | 2049/5/29 | | |
| CITIGROUP INC | 4.7 | 225 | 198 | 26,352 | 2099/1/23 | | |
| CITIGROUP INC | 4.0 | 75 | 68 | 9,044 | 2099/12/10 | | |
| CLARIOS GLOBAL LP | 6.75 | 45 | 45 | 5,999 | 2025/5/15 | | |
| CLEARWAY ENERGY OP LLC | 4.75 | 225 | 214 | 28,513 | 2028/3/15 | | |

| 銘柄 | 銘柄 | 第185期末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|--------|------|-------|--------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | CLEARWAY ENERGY OP LLC | 3.75 | 250 | 215 | 28,651 | 2031/2/15 |
| | CLEARWAY ENERGY OP LLC | 3.75 | 50 | 42 | 5,641 | 2032/1/15 |
| | CLEVELAND-CLIFFS INC | 5.875 | 50 | 49 | 6,628 | 2027/6/1 |
| | CLEVELAND-CLIFFS INC | 4.625 | 150 | 137 | 18,309 | 2029/3/1 |
| | CLEVELAND-CLIFFS INC | 4.875 | 125 | 114 | 15,217 | 2031/3/1 |
| | CLEVELAND-CLIFFS INC | 6.25 | 25 | 22 | 3,028 | 2040/10/1 |
| | CLOUD PEAK ENRGY | — | 300 | 0.825 | 109 | 2024/3/15 |
| | CNX RESOURCES CORP | 7.25 | 275 | 283 | 37,696 | 2027/3/14 |
| | CNX RESOURCES CORP | 6.0 | 100 | 98 | 13,136 | 2029/1/15 |
| | COEUR MINING INC | 5.125 | 175 | 137 | 18,262 | 2029/2/15 |
| | COINBASE GLOBAL INC | 3.375 | 50 | 36 | 4,847 | 2028/10/1 |
| | COINBASE GLOBAL INC | 3.625 | 250 | 168 | 22,360 | 2031/10/1 |
| | COLT MERGER SUB INC | 6.25 | 175 | 175 | 23,353 | 2025/7/1 |
| | COLT MERGER SUB INC | 8.125 | 175 | 176 | 23,452 | 2027/7/1 |
| | COMMERCIAL METALS CO | 4.125 | 100 | 90 | 12,038 | 2030/1/15 |
| | COMMERCIAL METALS CO | 4.375 | 50 | 43 | 5,819 | 2032/3/15 |
| | COMMSCOPE INC | 7.125 | 100 | 83 | 11,037 | 2028/7/1 |
| | COMMSCOPE INC | 4.75 | 50 | 43 | 5,780 | 2029/9/1 |
| | COMPASS MINERALS INTERNA | 6.75 | 100 | 95 | 12,695 | 2027/12/1 |
| | COMSTOCK RESOURCES INC | 5.875 | 275 | 263 | 34,983 | 2030/1/15 |
| | CONSENSUS CLOUD SOLUTION | 6.0 | 100 | 93 | 12,473 | 2026/10/15 |
| | CONSENSUS CLOUD SOLUTION | 6.5 | 100 | 88 | 11,725 | 2028/10/15 |
| | CONSTELLIUM SE | 3.75 | 250 | 220 | 29,328 | 2029/4/15 |
| | CP ATLAS BUYER INC | 7.0 | 225 | 181 | 24,167 | 2028/12/1 |
| | CQP HOLDCO LP/BIP-V CHIN | 5.5 | 500 | 464 | 61,721 | 2031/6/15 |
| | CRESTWOOD MID PARTNER LP | 5.75 | 75 | 74 | 9,829 | 2025/4/1 |
| | CRESTWOOD MID PARTNER LP | 5.625 | 150 | 144 | 19,209 | 2027/5/1 |
| | CRESTWOOD MID PARTNER LP | 6.0 | 225 | 212 | 28,274 | 2029/2/1 |
| | CROWNROCK LP/CROWNROCK F | 5.625 | 175 | 174 | 23,239 | 2025/10/15 |
| | CROWNROCK LP/CROWNROCK F | 5.0 | 75 | 73 | 9,806 | 2029/5/1 |
| | CSC HOLDINGS LLC | 7.5 | 250 | 225 | 29,991 | 2028/4/1 |
| | CSC HOLDINGS LLC | 5.75 | 200 | 159 | 21,135 | 2030/1/15 |
| | CSC HOLDINGS LLC | 4.5 | 200 | 165 | 21,924 | 2031/11/15 |
| | DARLING INGREDIENTS INC | 6.0 | 25 | 25 | 3,385 | 2030/6/15 |
| | DAVITA INC | 4.625 | 200 | 167 | 22,207 | 2030/6/1 |
| | DAVITA INC | 3.75 | 75 | 59 | 7,894 | 2031/2/15 |
| | DCP MIDSTREAM OPERATING | 5.125 | 625 | 620 | 82,403 | 2029/5/15 |
| | DELEK LOGISTICS PARTNERS | 6.75 | 275 | 269 | 35,776 | 2025/5/15 |
| | DELTA AIR LINES INC | 7.375 | 50 | 53 | 7,120 | 2026/1/15 |
| | DELTA AIR LINES/SKYMILES | 4.75 | 100 | 99 | 13,155 | 2028/10/20 |
| | DIAMOND SPORTS GR/DIAMON | 6.625 | 250 | 41 | 5,478 | 2027/8/15 |
| | DIEBOLD INC | 8.5 | 100 | 56 | 7,460 | 2024/4/15 |
| | DIEBOLD NIXDORF INC | 9.375 | 225 | 176 | 23,387 | 2025/7/15 |
| | DIGICEL GROUP 0.5 LTD | 8.0 | 424 | 412 | 54,771 | 2024/4/1 |
| | DIRECTV HOLDINGS/FING | 5.875 | 250 | 234 | 31,156 | 2027/8/15 |
| | DISH DBS CORP | 5.25 | 200 | 172 | 22,859 | 2026/12/1 |
| | DISH DBS CORP | 7.375 | 100 | 75 | 10,085 | 2028/7/1 |

| 銘柄 | 柄 | 第185期末 | | | | | 償還年月日 |
|---------------------|--------------------------|--------|--------|-------|--------|------------|-------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | DISH DBS CORP | 5.75 | 150 | 124 | 16,472 | 2028/12/1 | |
| | DISH DBS CORP | 5.125 | 125 | 88 | 11,789 | 2029/6/1 | |
| | DORNOCH DEBT MERGER SUB | 6.625 | 250 | 199 | 26,446 | 2029/10/15 | |
| | EARTHSTONE ENERGY HOL | 8.0 | 50 | 50 | 6,747 | 2027/4/15 | |
| | EDGEWELL PERSONAL CARE | 5.5 | 150 | 145 | 19,359 | 2028/6/1 | |
| | EMPIRE COMMUNITIES CORP | 7.0 | 100 | 89 | 11,837 | 2025/12/15 | |
| | ENDO LUX FIN CO I SARL | 6.125 | 100 | 74 | 9,908 | 2029/4/1 | |
| | ENDURANCE ACQ MERGER | 6.0 | 375 | 289 | 38,404 | 2029/2/15 | |
| | ENERGEAN ISRAEL FINANCE | 5.375 | 50 | 46 | 6,159 | 2028/3/30 | |
| | ENERGEAN ISRAEL FINANCE | 5.875 | 50 | 45 | 6,080 | 2031/3/30 | |
| | ENLINK MIDSTREAM PARTNER | 4.85 | 200 | 200 | 26,628 | 2026/7/15 | |
| | ENLINK MIDSTREAM PARTNER | 5.6 | 75 | 61 | 8,163 | 2044/4/1 | |
| | ENLINK MIDSTREAM PARTNER | 5.05 | 175 | 137 | 18,234 | 2045/4/1 | |
| | ENLINK MIDSTREAM PARTNER | 5.45 | 25 | 20 | 2,716 | 2047/6/1 | |
| | ENTERPRISE MERGER SUB IN | 8.75 | 100 | 31 | 4,202 | 2026/10/15 | |
| | EQM MIDSTREAM PARTNERS L | 4.0 | 75 | 74 | 9,923 | 2024/8/1 | |
| | EQM MIDSTREAM PARTNERS L | 6.0 | 150 | 153 | 20,322 | 2025/7/1 | |
| | EQM MIDSTREAM PARTNERS L | 7.5 | 50 | 50 | 6,706 | 2027/6/1 | |
| | EQM MIDSTREAM PARTNERS L | 6.5 | 100 | 99 | 13,154 | 2027/7/1 | |
| | EQM MIDSTREAM PARTNERS L | 4.5 | 100 | 88 | 11,713 | 2029/1/15 | |
| | EQM MIDSTREAM PARTNERS L | 7.5 | 50 | 50 | 6,763 | 2030/6/1 | |
| | EQT CORP | 7.5 | 150 | 166 | 22,074 | 2030/2/1 | |
| | ESC CB INTELSAT JA | — | 175 | — | — | 2025/7/15 | |
| | EVERI HOLDINGS INC | 5.0 | 50 | 44 | 5,940 | 2029/7/15 | |
| | EXELA INTERMED/EXELA FIN | 11.5 | 91 | 32 | 4,290 | 2026/7/15 | |
| | FERRELLGAS ESCROW LLC/FG | 5.375 | 175 | 158 | 21,022 | 2026/4/1 | |
| | FERRELLGAS ESCROW LLC/FG | 5.875 | 175 | 148 | 19,785 | 2029/4/1 | |
| | FERTITTA ENTERTAINMENT | 4.625 | 75 | 68 | 9,036 | 2029/1/15 | |
| | FIRSTENERGY CORP | 4.4 | 100 | 98 | 13,032 | 2027/7/15 | |
| | FMG RESOURCES AUG 2006 | 5.875 | 50 | 48 | 6,389 | 2030/4/15 | |
| | FMG RESOURCES AUG 2006 | 4.375 | 175 | 152 | 20,204 | 2031/4/1 | |
| | FMG RESOURCES AUG 2006 | 6.125 | 50 | 48 | 6,447 | 2032/4/15 | |
| | FONTAINEBLEAU LAS VEGAS | — | 11,815 | 30 | 4,080 | 2015/6/15 | |
| | FORD MOTOR COMPANY | 9.0 | 400 | 443 | 58,908 | 2025/4/22 | |
| | FORD MOTOR COMPANY | 9.625 | 75 | 90 | 12,002 | 2030/4/22 | |
| | FORD MOTOR COMPANY | 4.75 | 125 | 99 | 13,232 | 2043/1/15 | |
| | FORD MOTOR CREDI | 3.625 | 200 | 168 | 22,383 | 2031/6/17 | |
| | FORD MOTOR CREDIT CO LLC | 5.125 | 200 | 197 | 26,253 | 2025/6/16 | |
| | FORD MOTOR CREDIT CO LLC | 4.134 | 200 | 192 | 25,545 | 2025/8/4 | |
| | FORD MOTOR CREDIT CO LLC | 3.375 | 200 | 187 | 24,862 | 2025/11/13 | |
| | FORD MOTOR CREDIT CO LLC | 5.113 | 400 | 376 | 49,940 | 2029/5/3 | |
| | FORESTAR GROUP INC | 3.85 | 100 | 89 | 11,950 | 2026/5/15 | |
| | FORESTAR GROUP INC | 5.0 | 175 | 157 | 20,960 | 2028/3/1 | |
| | FORTRESS TRANS & INFRAST | 6.5 | 225 | 216 | 28,747 | 2025/10/1 | |
| | FORTRESS TRANS & INFRAST | 9.75 | 200 | 202 | 26,854 | 2027/8/1 | |
| | FOUNDATION BUILDING M | 6.0 | 75 | 60 | 8,055 | 2029/3/1 | |
| | FOXTROT ESCROW ISSUER | 12.25 | 100 | 95 | 12,732 | 2026/11/15 | |

| 銘柄 | 銘柄 | 第185期末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|--------|-------|---------|--------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | FREEDOM MORTGAGE | 6.625 | 125 | 105 | 13,989 | 2027/1/15 |
| | FRONTIER COMMUNICATIONS | 5.0 | 75 | 68 | 9,157 | 2028/5/1 |
| | FRONTIER COMMUNICATIONS | 5.875 | 39 | 33 | 4,405 | 2029/11/1 |
| | GARDA WORLD SECURITY | 6.0 | 125 | 102 | 13,668 | 2029/6/1 |
| | GENESIS ENERGY LP/FIN | 7.75 | 100 | 96 | 12,773 | 2028/2/1 |
| | GENWORTH MORTGAGE HLDING | 6.5 | 225 | 225 | 29,913 | 2025/8/15 |
| | GLOBAL AIR LEASE CO LTD | 6.5 | 754 | 606 | 80,579 | 2024/9/15 |
| | GO DADDY OPCO/FINCO | 5.25 | 100 | 98 | 13,036 | 2027/12/1 |
| | GOLDEN ENTERTAINMENT INC | 7.625 | 150 | 151 | 20,146 | 2026/4/15 |
| | GOODYEAR TIRE & RUBBER | 5.0 | 269 | 243 | 32,312 | 2029/7/15 |
| | GOODYEAR TIRE & RUBBER | 5.25 | 150 | 132 | 17,586 | 2031/7/15 |
| | GPS HOSPITALITY HOLDING | 7.0 | 150 | 108 | 14,368 | 2028/8/15 |
| | GRAHAM HOLDINGS CO | 5.75 | 125 | 126 | 16,738 | 2026/6/1 |
| | GRANITE HOLDINGS US ACQU | 11.0 | 300 | 291 | 38,716 | 2027/10/1 |
| | GRAY ESCROW II INC | 5.375 | 250 | 221 | 29,395 | 2031/11/15 |
| | GRAY ESCROW INC | 7.0 | 75 | 75 | 10,001 | 2027/5/15 |
| | GULFPORT ENERGY CORP | 8.0 | 65 | 67 | 9,028 | 2026/5/17 |
| | GULFPORT ENERGY ESCROW | — | 25 | 0.12625 | 16 | 2024/10/15 |
| | GULFPORT ENERGY ESCROW | — | 200 | 1 | 134 | 2025/5/15 |
| | GULFPORT ENERGY OP CORP | 8.0 | 2 | 3 | 401 | 2026/5/17 |
| | HARVEST MIDSTREAM I LP | 7.5 | 250 | 250 | 33,242 | 2028/9/1 |
| | HAT HOLDINGS I LLC/HAT | 6.0 | 50 | 50 | 6,702 | 2025/4/15 |
| | HAT HOLDINGS I LLC/HAT | 3.375 | 100 | 91 | 12,118 | 2026/6/15 |
| | HAT HOLDINGS I LLC/HAT | 3.75 | 300 | 250 | 33,239 | 2030/9/15 |
| | HAWAIIAN BRAND INTELLECT | 5.75 | 200 | 195 | 25,966 | 2026/1/20 |
| | HCA INC | 5.375 | 100 | 102 | 13,628 | 2025/2/1 |
| | HCA INC | 7.69 | 150 | 162 | 21,573 | 2025/6/15 |
| | HCA INC | 7.58 | 150 | 162 | 21,521 | 2025/9/15 |
| | HCA INC | 5.875 | 50 | 51 | 6,896 | 2026/2/15 |
| | HCA INC | 5.375 | 250 | 256 | 34,051 | 2026/9/1 |
| | HELLAS II | — | 5,050 | — | — | 2015/1/15 |
| | HERTZ CORP/THE | 4.625 | 50 | 44 | 5,972 | 2026/12/1 |
| | HERTZ CORP/THE | 5.0 | 75 | 63 | 8,494 | 2029/12/1 |
| | HESS MIDSTREAM | 5.625 | 175 | 176 | 23,421 | 2026/2/15 |
| | HESS MIDSTREAM OPERATION | 5.5 | 50 | 48 | 6,471 | 2030/10/15 |
| | HESS MIDSTREAM PARTNERS | 5.125 | 175 | 169 | 22,524 | 2028/6/15 |
| | HILCORP ENERGY I/HILCORP | 6.25 | 150 | 151 | 20,067 | 2028/11/1 |
| | HILCORP ENERGY I/HILCORP | 6.0 | 75 | 73 | 9,715 | 2030/4/15 |
| | HILCORP ENERGY I/HILCORP | 6.25 | 75 | 73 | 9,748 | 2032/4/15 |
| | HILTON DOMESTIC OPERATIN | 5.75 | 75 | 75 | 9,976 | 2028/5/1 |
| | HILTON DOMESTIC OPERATIN | 3.75 | 50 | 45 | 5,994 | 2029/5/1 |
| | HILTON DOMESTIC OPERATIN | 4.875 | 75 | 71 | 9,533 | 2030/1/15 |
| | HILTON GRAND VAC BOR ESC | 5.0 | 225 | 207 | 27,517 | 2029/6/1 |
| | HILTON GRAND VAC BOR ESC | 4.875 | 150 | 131 | 17,458 | 2031/7/1 |
| | HOLLY NRG PRTRN/FIN CORP | 6.375 | 50 | 49 | 6,632 | 2027/4/15 |
| | HOSPITALITY PROP TRUST | 4.35 | 150 | 136 | 18,096 | 2024/10/1 |
| | HOWARD MIDSTREAM ENERGY | 6.75 | 75 | 72 | 9,575 | 2027/1/15 |

| 銘柄 | 柄 | 第185期末 | | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|--------------------------|-------|-------|---------|-----------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | HUSKY III HOLDING LTD | 13.0 | 100 | 101 | 13,439 | 2025/2/15 |
| | | IAMGOLD CORP | 5.75 | 150 | 105 | 14,022 | 2028/10/15 |
| | | ICAHN ENTERPRISES/FIN | 4.75 | 125 | 121 | 16,169 | 2024/9/15 |
| | | ICAHN ENTERPRISES/FIN | 6.25 | 575 | 566 | 75,227 | 2026/5/15 |
| | | ICAHN ENTERPRISES/FIN | 5.25 | 75 | 70 | 9,406 | 2027/5/15 |
| | | ICAHN ENTERPRISES/FIN | 4.375 | 100 | 88 | 11,780 | 2029/2/1 |
| | | IHEARTCOMMUNICATIONS INC | 6.375 | 52 | 52 | 6,939 | 2026/5/1 |
| | | IHEARTCOMMUNICATIONS INC | 4.75 | 125 | 112 | 14,958 | 2028/1/15 |
| | | ILFC E-CAPITAL TRUST I | 4.05 | 320 | 250 | 33,255 | 2065/12/21 |
| | | ILIAD HOLDING SAS | 7.0 | 200 | 190 | 25,336 | 2028/10/15 |
| | | IMOLA MERGER CORP | 4.75 | 350 | 326 | 43,422 | 2029/5/15 |
| | | INTEL PKG HOLDCO ISSUER | 9.0 | 50 | 47 | 6,365 | 2026/1/15 |
| | | IRIS HOLDINGS INC | 8.75 | 75 | 70 | 9,379 | 2026/2/15 |
| | | IRIS MERGER SUB 2019 INC | 9.375 | 100 | 103 | 13,766 | 2028/2/15 |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 5.25 | 25 | 23 | 3,176 | 2028/3/15 |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 4.875 | 275 | 251 | 33,384 | 2029/9/15 |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 5.25 | 150 | 139 | 18,472 | 2030/7/15 |
| | | IRON MOUNTAIN INFO MGMT | 5.0 | 150 | 133 | 17,683 | 2032/7/15 |
| | | ITHACA ENERGY NORTH | 9.0 | 200 | 202 | 26,935 | 2026/7/15 |
| | | J2 GLOBAL | 4.625 | 174 | 149 | 19,881 | 2030/10/15 |
| | | JACOBS ENTERTAINMENT INC | 6.75 | 75 | 68 | 9,118 | 2029/2/15 |
| | | JAGUAR LAND ROVER AUTOMO | 7.75 | 200 | 198 | 26,308 | 2025/10/15 |
| | | JAGUAR LAND ROVER AUTOMO | 5.5 | 200 | 156 | 20,818 | 2029/7/15 |
| | | JAZZ SECURITIES DAC | 4.375 | 200 | 187 | 24,925 | 2029/1/15 |
| | | JBS USA/FOOD/FINANCE | 5.5 | 175 | 170 | 22,655 | 2030/1/15 |
| | | JC PENNEY CORP INC | — | 124 | 0.01247 | 1 | 2025/3/15 |
| | | JPMORGAN CHASE & CO | 6.75 | 150 | 153 | 20,382 | 2049/1/29 |
| | | JPMORGAN CHASE & CO | 4.6 | 100 | 89 | 11,917 | 2099/1/23 |
| | | K HOVNIANIAN ENTERPRISES | 13.5 | 79 | 80 | 10,754 | 2026/2/1 |
| | | K HOVNIANIAN ENTERPRISES | 5.0 | 79 | 55 | 7,409 | 2040/2/1 |
| | | KAISER ALUMINUM CORP | 4.625 | 175 | 162 | 21,539 | 2028/3/1 |
| | | KB HOME | 6.875 | 75 | 78 | 10,384 | 2027/6/15 |
| | | KB HOME | 4.8 | 100 | 92 | 12,261 | 2029/11/15 |
| | | KB HOME | 4.0 | 100 | 85 | 11,315 | 2031/6/15 |
| | | KEN GARFF AUTOMOTIVE LLC | 4.875 | 275 | 235 | 31,282 | 2028/9/15 |
| | | KINETIK HOLDINGS LP | 5.875 | 100 | 99 | 13,166 | 2030/6/15 |
| | | L BRANDS INC | 9.375 | 15 | 16 | 2,131 | 2025/7/1 |
| | | L BRANDS INC | 7.5 | 50 | 50 | 6,763 | 2029/6/15 |
| | | L BRANDS INC | 6.625 | 100 | 97 | 12,954 | 2030/10/1 |
| | | L BRANDS INC | 6.75 | 225 | 200 | 26,657 | 2036/7/1 |
| | LADDER CAP FIN LLLP/CORP | 4.25 | 75 | 68 | 9,117 | 2027/2/1 | |
| | LADDER CAP FIN LLLP/CORP | 4.75 | 50 | 44 | 5,929 | 2029/6/15 | |
| | LAMAR MEDIA CORP | 4.875 | 200 | 191 | 25,372 | 2029/1/15 | |
| | LAREDO PETROLEUM INC | 9.5 | 300 | 310 | 41,222 | 2025/1/15 | |
| | LAREDO PETROLEUM INC | 7.75 | 175 | 175 | 23,268 | 2029/7/31 | |
| | LBM ACQUISITION LLC | 6.25 | 100 | 80 | 10,675 | 2029/1/15 | |
| | LEEWARD RENEWABL | 4.25 | 275 | 239 | 31,756 | 2029/7/1 | |

| 銘柄 | 銘柄 | 第185期末 | | | | | 償還年月日 |
|------|------------------------|--------------------------|-------|-------|---------|-----------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 千円 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | | | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | LEVEL 3 FINANCING INC | 4.25 | 325 | 281 | 37,323 | 2028/7/1 |
| | | LEVEL 3 FINANCING INC | 3.75 | 75 | 61 | 8,217 | 2029/7/15 |
| | | LIFE TIME INC | 5.75 | 200 | 194 | 25,784 | 2026/1/15 |
| | | LIFE TIME INC | 8.0 | 300 | 289 | 38,497 | 2026/4/15 |
| | | LINDBLAD EXPEDITIONS LLC | 6.75 | 50 | 47 | 6,374 | 2027/2/15 |
| | | LITHIA MOTORS INC | 3.875 | 500 | 448 | 59,565 | 2029/6/1 |
| | | LOGAN MERGER SUB INC | 5.5 | 325 | 255 | 33,970 | 2027/9/1 |
| | | LSF11 A5 HOLDCO LLC | 6.625 | 250 | 213 | 28,375 | 2029/10/15 |
| | | LSF9 ATL HLDG/VICTRA FIN | 7.75 | 125 | 106 | 14,097 | 2026/2/15 |
| | | LUMEN TECHNOLOGIES INC | 5.375 | 100 | 83 | 11,139 | 2029/6/15 |
| | | MACY'S RETAIL HLDGS LLC | 5.875 | 100 | 93 | 12,355 | 2029/4/1 |
| | | MACY'S RETAIL HLDGS LLC | 5.875 | 25 | 22 | 2,953 | 2030/3/15 |
| | | MACY'S RETAIL HLDGS LLC | 6.125 | 25 | 21 | 2,890 | 2032/3/15 |
| | | MAGIC MERGERCO INC | 7.875 | 50 | 35 | 4,673 | 2029/5/1 |
| | | MALLINCKRODT FIN/SB | — | 150 | 58 | 7,722 | 2023/10/15 |
| | | MATADOR RESOURCES CO | 5.875 | 50 | 50 | 6,666 | 2026/9/15 |
| | | MATTAMY GROUP CORP | 4.625 | 125 | 102 | 13,565 | 2030/3/1 |
| | | MATTEL INC | 3.375 | 50 | 47 | 6,357 | 2026/4/1 |
| | | MATTEL INC | 3.75 | 50 | 46 | 6,218 | 2029/4/1 |
| | | MATTHEWS INTERNATIONAL C | 5.25 | 125 | 119 | 15,885 | 2025/12/1 |
| | | MAV ACQUISITION CORP | 8.0 | 125 | 107 | 14,268 | 2029/8/1 |
| | | MEG ENERGY CORP | 7.125 | 200 | 209 | 27,821 | 2027/2/1 |
| | | MERISANT ESCROW | 12.25 | 4,750 | — | — | 2014/5/15 |
| | | MERITAGE HOMES CORP | 3.875 | 200 | 177 | 23,589 | 2029/4/15 |
| | | METIS MERGER SUB LLC | 6.5 | 275 | 229 | 30,542 | 2029/5/15 |
| | | MGIC INVESTMENT CORP | 5.25 | 450 | 431 | 57,295 | 2028/8/15 |
| | | MGM RESORTS INTL | 5.5 | 164 | 156 | 20,731 | 2027/4/15 |
| | | MIDAS INT HOLDCO II/FIN | — | 375 | 421 | 56,029 | 2022/10/1 |
| | | MIDWEST VANADIUM PTY LTD | — | 186 | 0.46578 | 61 | 2023/2/15 |
| | | MINERVA MERGER SUB INC | 6.5 | 325 | 293 | 39,014 | 2030/2/15 |
| | | MIRABELA NICKEL LTD SUBO | — | 5 | — | — | 2044/9/10 |
| | | MOHEGAN GAMING & ENT | 8.0 | 375 | 333 | 44,255 | 2026/2/1 |
| | | MOLINA HEALTHCARE INC | 3.875 | 275 | 244 | 32,534 | 2032/5/15 |
| | | MOTION BONDCO DAC | 6.625 | 200 | 179 | 23,891 | 2027/11/15 |
| | | MOZART DEBT MERGER SUB | 3.875 | 300 | 265 | 35,194 | 2029/4/1 |
| | | MOZART DEBT MERGER SUB | 5.25 | 150 | 127 | 16,908 | 2029/10/1 |
| | | MPH ACQUISITION HOLDINGS | 5.5 | 25 | 23 | 3,112 | 2028/9/1 |
| | | MPT OPER PARTNERSP/FINL | 5.0 | 125 | 121 | 16,181 | 2027/10/15 |
| | | MPT OPER PARTNERSP/FINL | 4.625 | 175 | 162 | 21,550 | 2029/8/1 |
| | | MSCI INC | 3.875 | 175 | 158 | 21,044 | 2031/2/15 |
| | MURPHY OIL CORP | 5.875 | 200 | 200 | 26,671 | 2027/12/1 | |
| | NABORS INDUSTRIES INC | 5.75 | 125 | 120 | 16,046 | 2025/2/1 | |
| | NABORS INDUSTRIES INC | 7.375 | 50 | 50 | 6,706 | 2027/5/15 | |
| | NABORS INDUSTRIES LTD | 7.25 | 150 | 145 | 19,353 | 2026/1/15 | |
| | NABORS INDUSTRIES LTD | 7.5 | 75 | 71 | 9,440 | 2028/1/15 | |
| | NATIONSTAR MTG HLD INC | 6.0 | 50 | 48 | 6,419 | 2027/1/15 | |
| | NATIONSTAR MTG HLD INC | 5.5 | 125 | 113 | 15,136 | 2028/8/15 | |

| 銘柄 | 銘柄 | 第185期末 | | | | | 償還年月日 |
|--------------------------|--------------------------|------------------------|-------|--------|-----------|------------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | NATIONSTAR MTG HLD INC | 5.125 | 100 | 86 | 11,507 | 2030/12/15 |
| | NATIONSTAR MTG HLD INC | 5.75 | 50 | 43 | 5,840 | 2031/11/15 | |
| | NAVIENT CORP | 5.875 | 250 | 247 | 32,863 | 2024/10/25 | |
| | NAVIENT CORP | 6.75 | 50 | 50 | 6,643 | 2025/6/25 | |
| | NAVIENT CORP | 6.75 | 350 | 335 | 44,569 | 2026/6/15 | |
| | NAVIENT CORP | 5.5 | 150 | 129 | 17,176 | 2029/3/15 | |
| | NCL CORPORATION LTD | 5.875 | 350 | 306 | 40,748 | 2026/3/15 | |
| | NCL CORPORATION LTD | 7.75 | 50 | 43 | 5,719 | 2029/2/15 | |
| | NCL FINANCE LTD | 6.125 | 100 | 82 | 10,952 | 2028/3/15 | |
| | NCR CORP | 5.0 | 100 | 92 | 12,324 | 2028/10/1 | |
| | NCR CORP | 5.125 | 250 | 231 | 30,732 | 2029/4/15 | |
| | NCR CORP | 6.125 | 175 | 166 | 22,108 | 2029/9/1 | |
| | NCR CORP | 5.25 | 50 | 45 | 6,009 | 2030/10/1 | |
| | NEW ENTERPRISE STONE & L | 9.75 | 250 | 238 | 31,733 | 2028/7/15 | |
| | NEW ENTERPRISE STONE & L | 5.25 | 100 | 90 | 12,036 | 2028/7/15 | |
| | NEWS CORP | 3.875 | 275 | 245 | 32,629 | 2029/5/15 | |
| | NEWS CORP | 5.125 | 100 | 93 | 12,379 | 2032/2/15 | |
| | NEXSTAR BROADCASTING INC | 4.75 | 150 | 137 | 18,219 | 2028/11/1 | |
| | NEXTERA ENERGY OPERATING | 4.25 | 25 | 25 | 3,324 | 2024/9/15 | |
| | NEXTERA ENERGY OPERATING | 3.875 | 150 | 144 | 19,203 | 2026/10/15 | |
| | NFP CORP | 6.875 | 125 | 109 | 14,553 | 2028/8/15 | |
| | NFP CORP | 4.875 | 50 | 46 | 6,128 | 2028/8/15 | |
| | NGL ENRGY OP/FIN CORP | 7.5 | 225 | 212 | 28,207 | 2026/2/1 | |
| | NINE ENERGY SERVICE INC | 8.75 | 50 | 31 | 4,226 | 2023/11/1 | |
| | NMI HOLDINGS | 7.375 | 275 | 285 | 37,958 | 2025/6/1 | |
| | NORTHERN OIL AND GAS INC | 8.125 | 250 | 254 | 33,824 | 2028/3/1 | |
| | NORTHWEST ACQ/DOMINION | — | 100 | 0.006 | 0.796 | 2022/11/1 | |
| | NOVELIS CORP | 4.75 | 275 | 256 | 34,120 | 2030/1/30 | |
| | NRG ENERGY INC | 6.625 | 30 | 30 | 4,029 | 2027/1/15 | |
| | NRG ENERGY INC | 3.375 | 150 | 130 | 17,267 | 2029/2/15 | |
| | NRG ENERGY INC | 5.25 | 175 | 166 | 22,127 | 2029/6/15 | |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM | 3.4 | 150 | 144 | 19,149 | 2026/4/15 | |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 6.95 | 25 | 26 | 3,492 | 2024/7/1 | |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 3.45 | 175 | 174 | 23,233 | 2024/7/15 | |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 8.0 | 50 | 54 | 7,213 | 2025/7/15 | |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 5.875 | 200 | 206 | 27,473 | 2025/9/1 | |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 5.55 | 100 | 103 | 13,747 | 2026/3/15 | |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 6.375 | 150 | 161 | 21,441 | 2028/9/1 | |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 8.875 | 100 | 122 | 16,225 | 2030/7/15 | |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 6.625 | 225 | 248 | 32,954 | 2030/9/1 | |
| OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 6.125 | 150 | 160 | 21,305 | 2031/1/1 | | |
| OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 7.5 | 225 | 263 | 34,939 | 2031/5/1 | | |
| OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 6.45 | 75 | 82 | 11,007 | 2036/9/15 | | |
| OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 4.2 | 75 | 64 | 8,571 | 2048/3/15 | | |
| OLIN CORP | 5.625 | 75 | 74 | 9,915 | 2029/8/1 | | |
| OLIN CORP | 5.0 | 150 | 144 | 19,204 | 2030/2/1 | | |
| OLYMPUS WTR US HLDG CORP | 4.25 | 200 | 174 | 23,189 | 2028/10/1 | | |

| 銘柄 | 銘柄 | 第185期末 | | | | | 償還年月日 |
|------|-------------------------|--------------------------|-------|-------|--------|------------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | OLYMPUS WTR US HLDG CORP | 6.25 | 200 | 158 | 21,039 | 2029/10/1 |
| | | OPEN TEXT HOLDINGS INC | 4.125 | 125 | 114 | 15,245 | 2030/2/15 |
| | | OPEN TEXT/OPEN TEXT HOLD | 3.875 | 125 | 112 | 14,954 | 2029/12/1 |
| | | OPEN TEXT/OPEN TEXT HOLD | 4.125 | 125 | 110 | 14,727 | 2031/12/1 |
| | | ORGANON FINANCE 1 LLC | 5.125 | 200 | 185 | 24,603 | 2031/4/30 |
| | | OSCAR ACQUISITIONCO LLC | 9.5 | 75 | 65 | 8,746 | 2030/4/15 |
| | | OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C | 5.0 | 25 | 23 | 3,094 | 2027/8/15 |
| | | OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C | 4.25 | 125 | 107 | 14,327 | 2029/1/15 |
| | | OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C | 4.625 | 325 | 280 | 37,241 | 2030/3/15 |
| | | OWENS & MINOR INC | 6.625 | 150 | 147 | 19,584 | 2030/4/1 |
| | | PACIFIC GAS & ELECTRIC | 4.55 | 250 | 230 | 30,669 | 2030/7/1 |
| | | PAR PHARMACEUTICAL INC | 7.5 | 175 | 132 | 17,649 | 2027/4/1 |
| | | PARK RIVER HOLDINGS INC | 5.625 | 175 | 124 | 16,560 | 2029/2/1 |
| | | PARK-OHIO INDUSTRIES INC | 6.625 | 275 | 228 | 30,405 | 2027/4/15 |
| | | PARKLAND CORP/CANADA | 4.5 | 250 | 224 | 29,784 | 2029/10/1 |
| | | PARKLAND CORP/CANADA | 4.625 | 175 | 155 | 20,705 | 2030/5/1 |
| | | PARKLAND FUEL CORP | 5.875 | 100 | 97 | 13,014 | 2027/7/15 |
| | | PATRICK INDUSTRIES INC | 7.5 | 175 | 173 | 22,980 | 2027/10/15 |
| | | PATTERN ENERGY OP LP/PAT | 4.5 | 250 | 231 | 30,800 | 2028/8/15 |
| | | PBF HOLDING CO LLC | 9.25 | 125 | 130 | 17,289 | 2025/5/15 |
| | | PBF HOLDING CO LLC | 6.0 | 225 | 205 | 27,314 | 2028/2/15 |
| | | PBF LOGISTICS LP/FINANCE | 6.875 | 170 | 169 | 22,495 | 2023/5/15 |
| | | PECF USS INTERMEDIATE HO | 8.0 | 50 | 42 | 5,619 | 2029/11/15 |
| | | PENN VIRGINIA ESC LLC | 9.25 | 100 | 100 | 13,330 | 2026/8/15 |
| | | PENNYMAC FIN SVCS INC | 4.25 | 200 | 158 | 21,083 | 2029/2/15 |
| | | PENNYMAC FIN SVCS INC | 5.75 | 50 | 40 | 5,390 | 2031/9/15 |
| | | PETROBAKKEN ENERGY LTD | — | 450 | — | — | 2023/2/1 |
| | | PG&E CORP | 5.0 | 275 | 251 | 33,441 | 2028/7/1 |
| | | PM GENERAL PURCHASER LLC | 9.5 | 125 | 105 | 14,059 | 2028/10/1 |
| | | PRECISION DRILLING CORP | 7.125 | 75 | 74 | 9,899 | 2026/1/15 |
| | | PRECISION DRILLING CORP | 6.875 | 75 | 72 | 9,573 | 2029/1/15 |
| | | PREMIER ENTERTAINMENT SU | 5.625 | 125 | 98 | 13,027 | 2029/9/1 |
| | | PREMIER ENTERTAINMENT SU | 5.875 | 125 | 97 | 12,984 | 2031/9/1 |
| | | PRIME SECSRVC BRW/FINANC | 5.25 | 75 | 74 | 9,937 | 2024/4/15 |
| | | PRIME SECSRVC BRW/FINANC | 3.375 | 175 | 152 | 20,297 | 2027/8/31 |
| | | PRIME SECSRVC BRW/FINANC | 6.25 | 75 | 68 | 9,095 | 2028/1/15 |
| | | RADIAN GROUP INC | 6.625 | 25 | 25 | 3,416 | 2025/3/15 |
| | | RADIAN GROUP INC | 4.875 | 125 | 120 | 15,994 | 2027/3/15 |
| | | RANGE RESOURCES CORP | 8.25 | 125 | 134 | 17,824 | 2029/1/15 |
| | | RANGE RESOURCES CORP | 4.75 | 75 | 72 | 9,608 | 2030/2/15 |
| | REALOGY GROUP/CO-ISSUER | 5.75 | 225 | 191 | 25,476 | 2029/1/15 | |
| | REALOGY GROUP/CO-ISSUER | 5.25 | 125 | 104 | 13,892 | 2030/4/15 | |
| | ROCKCLIFF ENERGY II LLC | 5.5 | 200 | 191 | 25,379 | 2029/10/15 | |
| | ROLLS-ROYCE PLC | 5.75 | 200 | 195 | 25,981 | 2027/10/15 | |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 5.25 | 175 | 175 | 23,326 | 2022/11/15 | |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 9.125 | 200 | 204 | 27,119 | 2023/6/15 | |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 5.5 | 75 | 64 | 8,500 | 2026/8/31 | |

| 銘柄 | 柄 | 第185期末 | | | | 償還年月日 | |
|-------------------------|--------------------------|-------------------------|-------|--------|-----------|------------|-----------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 5.375 | 100 | 82 | 10,931 | 2027/7/15 |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 3.7 | 225 | 169 | 22,465 | 2028/3/15 | |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 5.5 | 350 | 280 | 37,318 | 2028/4/1 | |
| | RRI ENERGY ESCROW | — | 50 | — | — | 2027/6/15 | |
| | SANCHEZ ENERGY CORP | — | 342 | 5 | 681 | 2021/6/15 | |
| | SANCHEZ ENERGY CORP | — | 325 | 4 | 647 | 2023/1/15 | |
| | SBA COMMUNICATIONS CORP | 3.875 | 425 | 405 | 53,797 | 2027/2/15 | |
| | SCIENTIFIC GAMES INTERNA | 7.0 | 125 | 122 | 16,262 | 2028/5/15 | |
| | SCIENTIFIC GAMES INTERNA | 7.25 | 75 | 74 | 9,854 | 2029/11/15 | |
| | SCIL IV LLC / SCIL USA H | 5.375 | 325 | 302 | 40,193 | 2026/11/1 | |
| | SEALED AIR CORP | 5.0 | 25 | 24 | 3,225 | 2029/4/15 | |
| | SEASPAN CORP | 5.5 | 175 | 154 | 20,554 | 2029/8/1 | |
| | SELECT MEDICAL CORP | 6.25 | 150 | 149 | 19,866 | 2026/8/15 | |
| | SENSATA TECHNOLOGIES BV | 4.0 | 400 | 362 | 48,192 | 2029/4/15 | |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 4.5 | 75 | 65 | 8,657 | 2025/3/15 | |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 7.5 | 100 | 98 | 13,123 | 2025/9/15 | |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 5.25 | 300 | 256 | 34,030 | 2026/2/15 | |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 5.5 | 50 | 44 | 5,876 | 2027/12/15 | |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 4.95 | 25 | 19 | 2,552 | 2029/10/1 | |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 4.375 | 150 | 109 | 14,582 | 2030/2/15 | |
| | SHEA HOMES LP/FNDG CP | 4.75 | 75 | 66 | 8,807 | 2028/2/15 | |
| | SHEA HOMES LP/FNDG CP | 4.75 | 100 | 85 | 11,401 | 2029/4/1 | |
| | SHELF DRILL HOLD LTD | 8.875 | 100 | 100 | 13,303 | 2024/11/15 | |
| | SHELF DRILL HOLD LTD | 8.25 | 175 | 143 | 18,995 | 2025/2/15 | |
| | SINCLAIR TELEVISION GROU | 5.125 | 175 | 157 | 20,873 | 2027/2/15 | |
| | SINCLAIR TELEVISION GROU | 5.5 | 75 | 60 | 8,071 | 2030/3/1 | |
| | SINCLAIR TELEVISION GROU | 4.125 | 150 | 126 | 16,860 | 2030/12/1 | |
| | SIRIUS XM RADIO INC | 4.0 | 125 | 112 | 14,874 | 2028/7/15 | |
| | SIRIUS XM RADIO INC | 5.5 | 200 | 191 | 25,482 | 2029/7/1 | |
| | SIRIUS XM RADIO INC | 3.875 | 150 | 127 | 16,887 | 2031/9/1 | |
| | SM ENERGY CO | 6.625 | 350 | 350 | 46,603 | 2027/1/15 | |
| | SONIC AUTOMOTIVE INC | 4.625 | 75 | 64 | 8,538 | 2029/11/15 | |
| | SONIC AUTOMOTIVE INC | 4.875 | 75 | 62 | 8,344 | 2031/11/15 | |
| | SOUTHWESTERN ENERGY | 5.375 | 300 | 298 | 39,604 | 2029/2/1 | |
| | SOUTHWESTERN ENERGY CO | 5.375 | 200 | 200 | 26,565 | 2030/3/15 | |
| | SPCM SA | 3.375 | 200 | 162 | 21,642 | 2030/3/15 | |
| | SPECIALTY BUILDING PRODU | 6.375 | 125 | 115 | 15,353 | 2026/9/30 | |
| | SPIRIT AEROSYSTEMS INC | 7.5 | 225 | 228 | 30,316 | 2025/4/15 | |
| | SPIRIT AEROSYSTEMS INC | 4.6 | 50 | 42 | 5,697 | 2028/6/15 | |
| | SPIRIT LOYALTY KY LTD/IP | 8.0 | 125 | 130 | 17,390 | 2025/9/20 | |
| SPRINGLEAF FINANCE CORP | 6.875 | 25 | 25 | 3,334 | 2025/3/15 | | |
| SPRINGLEAF FINANCE CORP | 7.125 | 150 | 151 | 20,109 | 2026/3/15 | | |
| SPRINGLEAF FINANCE CORP | 6.625 | 225 | 221 | 29,370 | 2028/1/15 | | |
| SPRINT CAPITAL CORP | 8.75 | 550 | 701 | 93,129 | 2032/3/15 | | |
| SRM ESCROW ISSUER LLC | 6.0 | 225 | 210 | 27,938 | 2028/11/1 | | |
| SS&C TECHNOLOGIES INC | 5.5 | 250 | 247 | 32,883 | 2027/9/30 | | |
| STANDARD INDUSTRIES INC | 5.0 | 75 | 71 | 9,481 | 2027/2/15 | | |

| 銘柄 | 柄 | 第185期末 | | | | 償還年月日 | |
|--------------------------|--------------------------|-------------------------|------|--------|-----------|------------|-----------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | STANDARD INDUSTRIES INC | 4.75 | 50 | 45 | 6,107 | 2028/1/15 |
| | STANDARD INDUSTRIES INC | 4.375 | 100 | 85 | 11,396 | 2030/7/15 | |
| | STANDARD INDUSTRIES INC | 3.375 | 125 | 100 | 13,321 | 2031/1/15 | |
| | STAPLES INC | 7.5 | 75 | 68 | 9,140 | 2026/4/15 | |
| | STAPLES INC | 10.75 | 350 | 279 | 37,056 | 2027/4/15 | |
| | STL HOLDING CO LLC | 7.5 | 225 | 211 | 28,089 | 2026/2/15 | |
| | STUDIO CITY FINANCE LTD | 5.0 | 200 | 125 | 16,636 | 2029/1/15 | |
| | SUMMIT MID HLDS LLC / FI | 5.75 | 75 | 60 | 8,086 | 2025/4/15 | |
| | SUNNOVA ENERGY CORP | 5.875 | 257 | 234 | 31,104 | 2026/9/1 | |
| | SUNOCO LP/FINANCE CORP | 6.0 | 175 | 177 | 23,519 | 2027/4/15 | |
| | SUNOCO LP/FINANCE CORP | 4.5 | 75 | 68 | 9,063 | 2029/5/15 | |
| | SUNOCO LP/FINANCE CORP | 4.5 | 125 | 111 | 14,861 | 2030/4/30 | |
| | SWITCH LTD | 3.75 | 525 | 523 | 69,507 | 2028/9/15 | |
| | SWITCH LTD | 4.125 | 50 | 50 | 6,666 | 2029/6/15 | |
| | SYNEOS HEALTH INC | 3.625 | 275 | 243 | 32,360 | 2029/1/15 | |
| | T-MOBILE USA INC | 3.375 | 100 | 90 | 12,034 | 2029/4/15 | |
| | T-MOBILE USA INC | 3.5 | 125 | 112 | 14,956 | 2031/4/15 | |
| | T-MOBILE USA INC | 3.5 | 100 | 90 | 11,965 | 2031/4/15 | |
| | TALEN ENERGY SUPPLY LLC | — | 75 | 47 | 6,288 | 2026/1/15 | |
| | TALEN ENERGY SUPPLY LLC | — | 150 | 145 | 19,310 | 2027/5/15 | |
| | TALEN ENERGY SUPPLY LLC | — | 75 | 71 | 9,452 | 2028/1/15 | |
| | TALEN ENERGY SUPPLY LLC | — | 25 | 24 | 3,210 | 2028/6/1 | |
| | TALLGRASS NRG PRTRN/FIN | 6.0 | 175 | 155 | 20,616 | 2031/9/1 | |
| | TALOS PRODUCTION INC | 12.0 | 150 | 161 | 21,501 | 2026/1/15 | |
| | TAP ROCK RESOURCES LLC | 7.0 | 150 | 150 | 19,998 | 2026/10/1 | |
| | TARGA RESOURCES PARTNERS | 5.0 | 175 | 171 | 22,755 | 2028/1/15 | |
| | TARGA RESOURCES PARTNERS | 5.5 | 100 | 99 | 13,155 | 2030/3/1 | |
| | TARGA RESOURCES PARTNERS | 4.875 | 150 | 143 | 19,027 | 2031/2/1 | |
| | TARGA RESOURCES PARTNERS | 4.0 | 50 | 45 | 5,996 | 2032/1/15 | |
| | TAYLOR MORRISON | 6.625 | 75 | 75 | 9,987 | 2027/7/15 | |
| | TAYLOR MORRISON COMM | 5.75 | 100 | 98 | 13,111 | 2028/1/15 | |
| | TAYLOR MORRISON COMM | 5.125 | 75 | 70 | 9,308 | 2030/8/1 | |
| | TEGNA INC | 4.625 | 150 | 145 | 19,333 | 2028/3/15 | |
| | TEINE ENERGY LTD | 6.875 | 125 | 124 | 16,557 | 2029/4/15 | |
| | TELECOM ITALIA CAPITAL | 6.0 | 125 | 106 | 14,143 | 2034/9/30 | |
| | TELESAT CANADA/TELESAT L | 5.625 | 125 | 89 | 11,845 | 2026/12/6 | |
| | TELESAT CANADA/TELESAT L | 4.875 | 75 | 51 | 6,811 | 2027/6/1 | |
| | TELESAT CANADA/TELESAT L | 6.5 | 250 | 120 | 15,948 | 2027/10/15 | |
| | TENET HEALTHCARE CORP | 6.75 | 400 | 415 | 55,188 | 2023/6/15 | |
| | TENET HEALTHCARE CORP | 5.125 | 200 | 193 | 25,721 | 2027/11/1 | |
| TENET HEALTHCARE CORP | 4.625 | 75 | 70 | 9,386 | 2028/6/15 | | |
| TENET HEALTHCARE CORP | 6.125 | 300 | 282 | 37,501 | 2028/10/1 | | |
| TENET HEALTHCARE CORP | 4.25 | 175 | 159 | 21,177 | 2029/6/1 | | |
| TENET HEALTHCARE CORP | 6.125 | 125 | 124 | 16,601 | 2030/6/15 | | |
| TENNECO INC | 5.0 | 25 | 23 | 3,109 | 2026/7/15 | | |
| TENNECO INC | 5.125 | 100 | 96 | 12,761 | 2029/4/15 | | |
| TERRAFORM POWER OPERATIN | 4.75 | 125 | 117 | 15,637 | 2030/1/15 | | |

| 銘柄 | 銘柄 | 第185期末 | | | | |
|------|--------------------------|--------|------|-------|--------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | THOR INDUSTRIES | 4.0 | 50 | 40 | 5,442 | 2029/10/15 |
| | TITAN ACQ/CO-BORROWER | 7.75 | 100 | 94 | 12,507 | 2026/4/15 |
| | TMS INTERNATIONAL CORP | 6.25 | 150 | 119 | 15,812 | 2029/4/15 |
| | TOPS HOLDING II ESCROW | — | 307 | — | — | 2022/6/15 |
| | TPC GROUP INC | — | 50 | 26 | 3,537 | 2024/8/1 |
| | TRANSDIGM INC | 8.0 | 125 | 129 | 17,242 | 2025/12/15 |
| | TRANSDIGM INC | 6.25 | 150 | 151 | 20,083 | 2026/3/15 |
| | TRANSDIGM INC | 7.5 | 200 | 202 | 26,868 | 2027/3/15 |
| | TRANSDIGM INC | 5.5 | 450 | 423 | 56,283 | 2027/11/15 |
| | TRANSDIGM INC | 4.625 | 200 | 175 | 23,294 | 2029/1/15 |
| | TRANSDIGM INC | 4.875 | 150 | 132 | 17,663 | 2029/5/1 |
| | TRANSOCEAN GUARDIAN LTD | 5.875 | 15 | 14 | 1,921 | 2024/1/15 |
| | TRANSOCEAN INC | 11.5 | 140 | 140 | 18,721 | 2027/1/30 |
| | TRANSOCEAN INC | 8.0 | 100 | 78 | 10,471 | 2027/2/1 |
| | TRANSOCEAN POSEIDON | 6.875 | 46 | 44 | 5,943 | 2027/2/1 |
| | TRANSOCEAN SENTRY LTD | 5.375 | 56 | 54 | 7,237 | 2023/5/15 |
| | TRAVEL + LEISURE CO | 4.5 | 100 | 89 | 11,950 | 2029/12/1 |
| | TRI POINTE GROUP INC | 5.25 | 50 | 47 | 6,320 | 2027/6/1 |
| | TRI POINTE GROUP INC | 5.7 | 75 | 71 | 9,540 | 2028/6/15 |
| | TRIDENT TPI HOLDINGS INC | 9.25 | 175 | 171 | 22,753 | 2024/8/1 |
| | TRONOX INC | 4.625 | 175 | 154 | 20,505 | 2029/3/15 |
| | TWITTER INC | 5.0 | 50 | 49 | 6,516 | 2030/3/1 |
| | UBER TECHNOLOGIES INC | 8.0 | 25 | 25 | 3,413 | 2026/11/1 |
| | UBER TECHNOLOGIES INC | 7.5 | 225 | 229 | 30,545 | 2027/9/15 |
| | UBER TECHNOLOGIES INC | 6.25 | 100 | 98 | 13,060 | 2028/1/15 |
| | UBER TECHNOLOGIES INC | 4.5 | 125 | 108 | 14,473 | 2029/8/15 |
| | UNITED AIRLINES HOLDINGS | 5.0 | 25 | 24 | 3,309 | 2024/2/1 |
| | UNITED AIRLINES HOLDINGS | 4.875 | 125 | 121 | 16,170 | 2025/1/15 |
| | UNITED AIRLINES INC | 4.375 | 100 | 94 | 12,516 | 2026/4/15 |
| | UNITED AIRLINES INC | 4.625 | 100 | 91 | 12,185 | 2029/4/15 |
| | UNITED RENTALS NORTH AM | 4.0 | 100 | 89 | 11,944 | 2030/7/15 |
| | UNITED RENTALS NORTH AM | 3.75 | 100 | 86 | 11,509 | 2032/1/15 |
| | UNITED WHOLESALE MTGE LL | 5.75 | 50 | 43 | 5,831 | 2027/6/15 |
| | UNITED WHOLESALE MTGE LL | 5.5 | 150 | 125 | 16,654 | 2029/4/15 |
| | UNIVISION COMMUNICATIONS | 5.125 | 175 | 171 | 22,810 | 2025/2/15 |
| | UNIVISION COMMUNICATIONS | 9.5 | 75 | 78 | 10,363 | 2025/5/1 |
| | UNIVISION COMMUNICATIONS | 4.5 | 100 | 89 | 11,846 | 2029/5/1 |
| | UPC BROADBAND FINCO BV | 4.875 | 200 | 180 | 23,942 | 2031/7/15 |
| | UPC HOLDING BV | 5.5 | 200 | 186 | 24,750 | 2028/1/15 |
| | USA COM PART/USA COM FIN | 6.875 | 225 | 219 | 29,146 | 2026/4/1 |
| | USA COM PART/USA COM FIN | 6.875 | 125 | 123 | 16,376 | 2027/9/1 |
| | VALEANT PHARMACEUTICALS | 9.0 | 150 | 127 | 16,912 | 2025/12/15 |
| | VENTURE GLOBAL CALCASIEU | 3.875 | 125 | 114 | 15,265 | 2029/8/15 |
| | VENTURE GLOBAL CALCASIEU | 4.125 | 100 | 91 | 12,113 | 2031/8/15 |
| | VENTURE GLOBAL CALCASIEU | 3.875 | 125 | 110 | 14,685 | 2033/11/1 |
| | VERMILION ENERGY INC | 6.875 | 100 | 96 | 12,807 | 2030/5/1 |
| | VERSCEND HOLDING CORP | 9.75 | 150 | 151 | 20,166 | 2026/8/15 |

| 銘 | 柄 | 第185期末 | | | | |
|------|--------------------------|--------|------|-------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債) | | | | | |
| | VICI PROPERTIES / NOTE | 4.25 | 75 | 71 | 9,460 | 2026/12/1 |
| | VICI PROPERTIES / NOTE | 4.625 | 105 | 97 | 12,997 | 2029/12/1 |
| | VICI PROPERTIES / NOTE | 4.125 | 50 | 45 | 5,997 | 2030/8/15 |
| | VICI PROPERTIES/NOTE | 4.5 | 175 | 167 | 22,223 | 2026/9/1 |
| | VICTORS MERGER CORP | 6.375 | 75 | 48 | 6,486 | 2029/5/15 |
| | VIDTRON LTD/VIDTRON LTEE | 3.625 | 250 | 212 | 28,243 | 2029/6/15 |
| | VIKING CRUISES LTD | 13.0 | 175 | 190 | 25,260 | 2025/5/15 |
| | VIKING CRUISES LTD | 5.875 | 150 | 125 | 16,631 | 2027/9/15 |
| | VIKING CRUISES LTD | 7.0 | 100 | 84 | 11,172 | 2029/2/15 |
| | VIKING OCEAN CRUISES SHI | 5.625 | 50 | 43 | 5,739 | 2029/2/15 |
| | VIPER ENERGY PARTNERS LP | 5.375 | 225 | 223 | 29,630 | 2027/11/1 |
| | VIRGIN AUSTRALIA HOLDING | — | 50 | 2 | 350 | 2024/11/15 |
| | VISTAJET MALTA/XO MGMT | 7.875 | 100 | 95 | 12,634 | 2027/5/1 |
| | VISTAJET MALTA/XO MGMT | 6.375 | 175 | 151 | 20,075 | 2030/2/1 |
| | VISTRA CORP | 7.0 | 225 | 216 | 28,746 | 2099/12/10 |
| | VISTRA OPERATIONS CO LLC | 5.0 | 150 | 143 | 19,102 | 2027/7/31 |
| | VMED O2 UK FINANCING I | 4.25 | 200 | 171 | 22,821 | 2031/1/31 |
| | VODAFONE GROUP PLC | 7.0 | 155 | 162 | 21,546 | 2079/4/4 |
| | WASH MULTIFAM ACQ INC | 5.75 | 275 | 272 | 36,130 | 2026/4/15 |
| | WEATHERFORD INTERNATIONA | 8.625 | 150 | 140 | 18,683 | 2030/4/30 |
| | WEEKLEY HOMES LLC/ FINAN | 4.875 | 225 | 198 | 26,371 | 2028/9/15 |
| | WERNER FINCO LP/INC | 8.75 | 300 | 269 | 35,815 | 2025/7/15 |
| | WESTERN GLOBAL AIRLINES | 10.375 | 100 | 100 | 13,328 | 2025/8/15 |
| | WESTERN MIDSTREAM OPERAT | 3.6 | 175 | 168 | 22,370 | 2025/2/1 |
| | WESTERN MIDSTREAM OPERAT | 4.55 | 100 | 92 | 12,323 | 2030/2/1 |
| | WESTERN MIDSTREAM OPERAT | 5.3 | 150 | 136 | 18,065 | 2048/3/1 |
| | WHITE CAP BUYER LLC | 6.875 | 125 | 111 | 14,759 | 2028/10/15 |
| | WHITE CAP PARENT LLC | 8.25 | 150 | 138 | 18,360 | 2026/3/15 |
| | WR GRACE HOLDING LLC | 5.625 | 375 | 313 | 41,586 | 2029/8/15 |
| | WYNDHAM DESTINATIONS INC | 6.625 | 150 | 154 | 20,559 | 2026/7/31 |
| | WYNN LAS VEGAS LLC/CORP | 5.5 | 50 | 48 | 6,450 | 2025/3/1 |
| | WYNN RESORTS FINANCE LLC | 5.125 | 50 | 43 | 5,774 | 2029/10/1 |
| | YUM! BRANDS INC | 5.375 | 125 | 119 | 15,879 | 2032/4/1 |
| | ZIGGO BV | 4.875 | 200 | 181 | 24,110 | 2030/1/15 |
| 合 | 計 | | | | 11,910,521 | |

* 邦貨換算金額は、第185期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* 評価額が「—」となっている銘柄は、評価を計上していません。

外国その他有価証券

(A) 外国貸付債権

| 区 分 | 第185期末 | | |
|----------------|-------------|--------------|----------|
| | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比 率 |
| (アメリカ) 貸付債権 | 千米ドル 361 | 千円 48,077 | % 0.4 |
| 合 計 | 361 | 48,077 | 0.4 |

* 邦貨換算金額は、第185期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 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。

(B) 外国貸付債権 銘柄別

| 銘 柄 | 第185期末 | | | | 償還年月日 |
|--------------------------|----------|-------|-------|--------|-----------|
| | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| 貸付債権 | | | | | |
| GLOBAL AVIATION 2ND LIEN | 0.0 | 276 | 0 | 0 | 2022/8/13 |
| PARKER DRILLING 2ND | 11.0 | 18 | 18 | 2,398 | 2024/3/26 |
| ASCENT RESOURCES TL | 10.02143 | 115 | 121 | 16,189 | 2025/11/1 |
| STAPLES 2019 RFNIG B1 TL | 6.286 | 145 | 132 | 17,651 | 2026/4/9 |
| DIAMOND SPORTS B TRM | 4.43077 | 73 | 21 | 2,903 | 2026/8/24 |
| CLEAR CHANNEL OUTD B#1 | 4.73886 | 72 | 67 | 8,911 | 2026/8/9 |
| CLEAR CHANNEL OUTD B#10 | 4.55957 | 0.187 | 0.172 | 22 | 2026/8/9 |
| 合 計 | | | | 48,077 | |

* 邦貨換算金額は、第185期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* 決算日時点で受け渡しが完了していない新規買付ローンに関しましては、クーポンレートが確定しておりません。

野村米国好利回り社債投信 マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日2021年12月8日）

作成対象期間（2020年12月9日～2021年12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。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | 主として米国ドル建ての高利回り事業債（ハイ・イールド・ボンド）に投資し、高水準のインカムゲインと中長期的な値上がり益の獲得によるトータル・リターンの追求を目指し、積極的な運用を行いません。 |
| 主な投資対象 | 米国ドル建ての高利回り事業債を主要投資対象とします。ディストレス債券やデフォルト債券などを含め幅広い低格付証券に投資を行いません。投資対象には、米国以外の企業の発行する債券等が含まれます。 |
| 主な投資制限 | 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 |

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|------------------|--------|-------|--------|-------|--------|----------------------------|--------|--------|--------|
| | 騰落率 | 中 | 騰落率 | 中 | | | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 11期(2017年12月8日) | 23,588 | 7.6 | 216.60 | 7.7 | 1.9 | — | 89.7 | — | 20,855 |
| 12期(2018年12月10日) | 23,483 | △ 0.4 | 215.32 | △ 0.6 | 0.9 | 0.0 | 89.8 | — | 16,305 |
| 13期(2019年12月9日) | 24,888 | 6.0 | 229.00 | 6.4 | 0.6 | 0.0 | 90.6 | — | 14,485 |
| 14期(2020年12月8日) | 25,635 | 3.0 | 234.45 | 2.4 | 0.4 | — | 95.5 | — | 12,658 |
| 15期(2021年12月8日) | 30,142 | 17.6 | 270.52 | 15.4 | 0.8 | — | 93.9 | — | 12,642 |

* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

* 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

* ベンチマーク(=ICE BofA US High Yield Constrained Index(円換算ベース))は、ICE BofA US High Yield Constrained Index(US\$ベース)をもとに、当社が独自に円換算したものです。なお、算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しております。
ベンチマークは設定時を100として指数化しています。
(出所および許可)ICE Data Indices, LLC

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 |
|------------|--------|------|--------|------|--------|----------------------------|--------|--------|
| | 騰落率 | 騰落率 | | | | | | |
| (期首) | 円 | % | | % | % | % | % | % |
| 2020年12月8日 | 25,635 | — | 234.45 | — | 0.4 | — | 95.5 | — |
| 12月末 | 25,732 | 0.4 | 235.07 | 0.3 | 0.4 | — | 95.7 | — |
| 2021年1月末 | 26,235 | 2.3 | 238.68 | 1.8 | 0.4 | — | 96.0 | — |
| 2月末 | 26,887 | 4.9 | 243.79 | 4.0 | 0.4 | — | 96.4 | — |
| 3月末 | 28,039 | 9.4 | 253.48 | 8.1 | 0.5 | — | 95.6 | — |
| 4月末 | 28,047 | 9.4 | 252.59 | 7.7 | 0.5 | — | 94.9 | — |
| 5月末 | 28,375 | 10.7 | 255.29 | 8.9 | 0.9 | — | 95.3 | — |
| 6月末 | 28,986 | 13.1 | 260.47 | 11.1 | 1.0 | — | 94.6 | — |
| 7月末 | 28,769 | 12.2 | 259.04 | 10.5 | 1.3 | — | 93.4 | — |
| 8月末 | 29,021 | 13.2 | 261.31 | 11.5 | 0.9 | — | 92.8 | — |
| 9月末 | 29,670 | 15.7 | 266.52 | 13.7 | 0.9 | — | 93.4 | — |
| 10月末 | 30,118 | 17.5 | 270.19 | 15.2 | 0.9 | — | 93.9 | — |
| 11月末 | 29,853 | 16.5 | 267.82 | 14.2 | 0.9 | — | 93.8 | — |
| (期末) | | | | | | | | |
| 2021年12月8日 | 30,142 | 17.6 | 270.52 | 15.4 | 0.8 | — | 93.9 | — |

* 騰落率は期首比です。

* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

* 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、ICE BofA US High Yield Constrained Index (円換算ベース) です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は当作成期首の25,635円から当作成期末には30,142円となりました。

- ・ハイ・イールド債券からの利息収入
- ・新型コロナウイルスのワクチン普及や新規感染者数の減少傾向を背景に経済活動の正常化が進むとの見方などからハイ・イールド債券市場が上昇したこと
- ・FOMC（米連邦公開市場委員会）でテーパリング（量的金融緩和の縮小）の年内着手と2022年中の利上げ開始が示唆され、米長期金利が上昇したことなどを背景にハイ・イールド債券市場が下落したこと
- ・新型コロナウイルスの新たな変異株の発見でリスク回避の動きが広がったことなどを背景にハイ・イールド債券市場が下落したこと
- ・円・ドルの為替相場推移

○当ファンドのポートフォリオ

・資産別組入比率

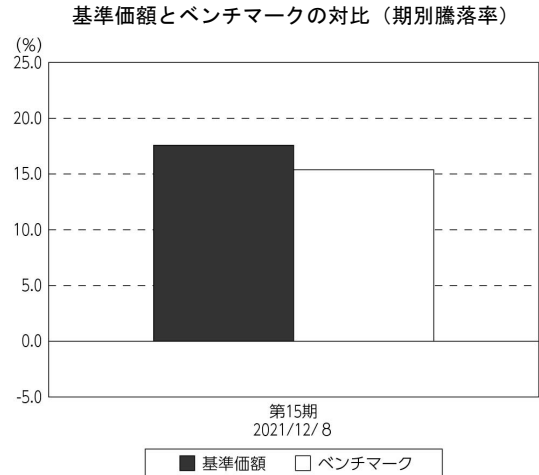
ハイ・イールド債券（ローン等を含む）の組み入れを高位に維持しました。

・信用格付け別組入比率

信用格付け別組入比率については、B格を中心に、CCC格やBB格など幅広く組み入れを行ないました。BBB格以上、BB格、B格、CCC格以下、無格付けの組入比率は、11月末には0.6%、30.4%、38.8%、21.7%、4.4%としました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当作成期首から当作成期末の間に、基準価額の騰落率は+17.6%となり、ベンチマークであるICE BofA US High Yield Constrained Index（円換算ベース）の+15.4%を2.2ポイント上回りました。主な差異要因は、資本財セクター、娯楽セクターの銘柄選択効果がプラスに作用し、通信セクターの銘柄選択効果がマイナスに作用したことなどでした。



(注) ベンチマークは、ICE BofA US High Yield Constrained Index（円換算ベース）です。

◎今後の運用方針

- ・当ファンドでは個別発行体の信用力を調査・分析するボトムアップ・アプローチに基づいて運用を行なっていきます。また、ハイ・イールド債券が持つ価格下落リスクをできる限り回避しながら、高水準のインカム（利息）収入やキャピタル・ゲイン（値上がり益）の獲得を目指す方針です。
- ・米国ハイ・イールド債券市場は、足元では中国の景気減速、サプライチェーンの停滞による供給不足、新型コロナウイルスのオミクロン株の感染拡大に対する懸念などにより、やや軟調に推移していますが、引き続きハイ・イールド債を発行している企業の収益は好調であり、投資適格級へ格上げされるハイ・イールド発行体が増加することが期待できるなど、堅調に推移することが予想されます。引き続き、FRB（米連邦準備制度理事会）による金融政策やバイデン米政権による財政政策などを注視しながら、景気動向に左右されにくい銘柄を選定して運用を行なって参ります。
- ・個別銘柄の選択にはより一層慎重に対応していきますが、今後もキャッシュフロー（現金収支）が安定的な企業や良好な収益見通しが期待できる企業を中心に投資を行なう方針です。組み入れに当たっては、ディストレス債やデフォルト債を含むハイ・イールド債券を中心に、ローンや優先証券など幅広く投資を行なっていきます。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願いいたします。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年12月9日～2021年12月8日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---|---------------------|-----------------------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) | 円 0 (0) | % 0.000 (0.000) | (a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) | 0 (0) | 0.000 (0.000) | (b) 有価証券取引税=期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他) | 25 (25) (0) | 0.087 (0.087) (0.000) | (c) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 25 | 0.087 | |
| 期中の平均基準価額は、28,311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

(2020年12月9日～2021年12月8日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|------|------------------|--------------------|---------------------|------------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 国 | アメリカ | 百株 — (602) | 千米ドル — (620) | 百株 500 (0.11) | 千米ドル 930 (0.726) |

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

*()内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

新株予約権証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|--------|------|-------------------|-------------------------|-----------------------|-------------------|
| | | 証 券 数 | 金 額 | 証 券 数 | 金 額 |
| 外 国 | アメリカ | 証券 — (133) | 千米ドル — (0. 28356) | 証券 — (410, 094) | 千米ドル — (4) |

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* ()内は権利割当、権利行使および権利行使期間満了などによる増減分です。

公社債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|--------|------|-----------------|--------------------------|------------------------------|
| 外 国 | アメリカ | 社債券 (投資法人債券を含む) | 千米ドル 65, 925 (86) | 千米ドル 68, 104 (10, 522) |

*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 |
|--------|------|------|---------------------|--------------------------|
| 外 国 | アメリカ | 貸付債権 | 千米ドル 842 (4) | 千米ドル 1, 298 (446) |

*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、上段の数字には含まれておりません。

○株式売買比率

(2020年12月9日～2021年12月8日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|------------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 103, 226千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 90, 070千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1. 14 |

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年12月9日～2021年12月8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 | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 為替直物取引 | 31 | 31 | 100.0 | 2,166 | — | — |

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信託銀行です。

○組入資産の明細

(2021年12月8日現在)

外国株式

| 銘 柄 | 株 数 | 当 期 末 | | | | 業 種 等 |
|-------------------------------------|-------|-----------|---------|--------|-----|--------------------|
| | | 株 数 | 評 価 額 | | 株 数 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | | |
| AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A | 7 | — | — | — | — | 娯楽 |
| BLUESTEM GROUP INC | 113 | 113 | 2 | 322 | — | インターネット販売・通信販売 |
| CALIFORNIA RESOURCES CORP | — | 0.8 | 3 | 395 | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CLOUD PEAK ENERGY INC | 0.59 | 0.59 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CORNERSTONE BUILDING BRANDS INC | 30 | — | — | — | — | 建設関連製品 |
| DIRECTBUY HOLDINGS INC | 27 | 27 | — | — | — | 専門小売り |
| FTS INTERNATIONAL INC-CL A | 43 | 42 | 110 | 12,542 | — | エネルギー設備・サービス |
| FERRELLGAS PARTNERS LP-B | — | 1 | 44 | 5,064 | — | ガス |
| GULFPORT ENERGY CORP | — | 24 | 168 | 19,193 | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HEXION HOLDINGS CORP -B | 154 | 109 | 295 | 33,568 | — | 化学 |
| NEENAH ENTERPRISES INC | 1,077 | 1,077 | — | — | — | 金属・鉱業 |
| PARKER DRILLING CO-POST BANK | 9 | 9 | 4 | 494 | — | エネルギー設備・サービス |
| UC HOLDINGS INC | 68 | 68 | 47 | 5,425 | — | 自動車部品 |
| VISTRA CORP | 33 | 33 | 69 | 7,875 | — | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| HERCULES OFFSHORE ESCROW COM | 119 | 119 | — | — | — | エネルギー設備・サービス |
| WARREN RESOURCES INC | 36 | 36 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| VISTRA CORP RIGHTS | 38 | 38 | 5 | 577 | — | 電力 |
| NINE POINT ENERGY HOLDINGS-PFD | 0.46 | 0.46 | 1 | 130 | — | エネルギー設備・サービス |
| NINE POINT ENERGY HOLDINGS COMMON | 27 | 27 | 0.67675 | 76 | — | エネルギー設備・サービス |
| RUE21 CLASS A COM | 0.11 | — | — | — | — | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| SUNEDISON INC COM | 3 | 3 | 4 | 520 | — | 電力 |
| GATEWAY CASINO LIMITED COMMON STOCK | 1,408 | 1,408 | — | — | — | ホテル・レストラン・レジャー |
| BRUIN BLOCKER LLC COM | — | 152 | 0.175 | 19 | — | エネルギー設備・サービス |
| GULFPORT ENERGY PFD | — | 0.06 | 35 | 4,020 | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HARDWOODS HOLDINGS COM | — | 4 | 28 | 3,189 | — | 建設 |
| 合 計 | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 | 株 数 | |
| | 銘 柄 | 数 < 比 率 > | 19 | 22 | — | < 0.7% > |

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 邦貨換算金額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

外国新株予約権証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | |
|--|---------|-----------|---------|--------|--------|
| | | 証 券 数 | 証 券 数 | 評 価 額 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (アメリカ) | 証券 | 証券 | 千米ドル | 千円 | |
| CALIFORNIA RESOURCES WARRANT | — | 133 | 1 | 188 | |
| DENBURY-CW25 09/18/25 | 875 | 875 | 45 | 5,163 | |
| IHEARTMEDIA INC-CLASS A CW39 | 755 | 755 | 9 | 1,075 | |
| IPAYMENT HOLDINGS INC WARRANT 12/29/2022 | 836,360 | 836,360 | — | — | |
| VISTRA CORP - CW24 | 1,823 | 1,823 | 0.22131 | 25 | |
| MOOD MEDIA LLC WARRANT US61535E1139 | 136,698 | — | — | — | |
| MOOD MEDIA LLC WARRANT US61535E1212 | 136,698 | — | — | — | |
| MOOD MEDIA LLC WARRANT US61535E1394 | 136,698 | — | — | — | |
| APPVION CORP WRT US03835B1263 | 341 | 341 | — | — | |
| APPVION CORP WRT US03835B1180 | 341 | 341 | — | — | |
| 合 計 | 証券数・金額 | 1,250,589 | 840,628 | 6,453 | |
| | 銘柄数<比率> | 9 | 7 | <0.1%> | |

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* <>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

* 単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

外国公社債

(A) 外国(外貨建)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 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| アメリカ | 137,031 | 104,513 | 11,869,587 | 93.9 | 90.1 | 65.9 | 25.3 | 2.7 |
| 合 計 | 137,031 | 104,513 | 11,869,587 | 93.9 | 90.1 | 65.9 | 25.3 | 2.7 |

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

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

* S&Pグローバル・レーティング、ムーディーズ・インベスターズ・サービスによる格付けを採用しています。なお、無格付けが3.0%あります。

(B) 外国 (外貨建) 公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|--------|-------|---------|--------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | 1011778 BC / NEW RED FIN | 4.375 | 100 | 101 | 11,515 | 2028/1/15 |
| | 1839688 ALBERTA ULC | — | 181 | 0.29529 | 33 | 2023/2/13 |
| | ACRISURE LLC / FIN INC | 7.0 | 275 | 276 | 31,366 | 2025/11/15 |
| | ACRISURE LLC / FIN INC | 10.125 | 75 | 82 | 9,327 | 2026/8/1 |
| | ACRISURE LLC / FIN INC | 4.25 | 125 | 121 | 13,820 | 2029/2/15 |
| | ADAMS HOMES INC | 7.5 | 75 | 78 | 8,914 | 2025/2/15 |
| | ADT SEC CORP | 4.125 | 100 | 99 | 11,289 | 2029/8/1 |
| | ADTALEM GLOBAL EDUCATION | 5.5 | 225 | 219 | 24,881 | 2028/3/1 |
| | AETHON UN/AETHIN UN FIN | 8.25 | 150 | 158 | 18,050 | 2026/2/15 |
| | AFFINITY GAMING | 6.875 | 125 | 128 | 14,539 | 2027/12/15 |
| | AG ISSUER LLC | 6.25 | 125 | 130 | 14,790 | 2028/3/1 |
| | AHERN RENTALS INC | 7.375 | 275 | 262 | 29,826 | 2023/5/15 |
| | AHP HEALTH PARTN | 5.75 | 50 | 49 | 5,602 | 2029/7/15 |
| | AIR CANADA | 3.875 | 75 | 76 | 8,685 | 2026/8/15 |
| | ALBERTSONS COS/SAFEWAY | 4.625 | 100 | 105 | 11,972 | 2027/1/15 |
| | ALBERTSONS COS/SAFEWAY | 4.875 | 100 | 107 | 12,247 | 2030/2/15 |
| | ALLEGHENY TECHNOLOGIES | 4.875 | 125 | 124 | 14,136 | 2029/10/1 |
| | ALLEGHENY TECHNOLOGIES | 5.125 | 25 | 24 | 2,836 | 2031/10/1 |
| | ALLEN MEDIA LLC/CO-ISSR | 10.5 | 150 | 161 | 18,368 | 2028/2/15 |
| | ALLIED UNIVERSAL HOLDCO | 6.625 | 150 | 156 | 17,815 | 2026/7/15 |
| | ALLIED UNIVERSAL HOLDCO | 9.75 | 250 | 266 | 30,231 | 2027/7/15 |
| | ALTICE FINANCING SA | 5.0 | 200 | 194 | 22,076 | 2028/1/15 |
| | ALTICE FRANCE HOLDING SA | 10.5 | 400 | 431 | 48,987 | 2027/5/15 |
| | ALTICE FRANCE HOLDING SA | 6.0 | 200 | 192 | 21,807 | 2028/2/15 |
| | ALTICE FRANCE SA | 5.125 | 275 | 269 | 30,607 | 2029/7/15 |
| | ALTICE FRANCE SA | 5.5 | 200 | 198 | 22,530 | 2029/10/15 |
| | ALTOS ESCROW DEBT | 11.375 | 1,675 | — | — | 2002/4/30 |
| | ALTOS ESCROW DEBT | 11.875 | 4,010 | — | — | 2004/4/30 |
| | AMC ENTERTAINMENT HOLDIN | 10.5 | 28 | 29 | 3,383 | 2026/4/24 |
| | AMC ENTERTAINMENT HOLDIN | — | 264 | 269 | 30,592 | 2026/6/15 |
| | AMERICAN AIRLINES GROUP | 5.0 | 100 | 99 | 11,342 | 2022/6/1 |
| | AMERICAN AIRLINES INC | 11.75 | 275 | 338 | 38,421 | 2025/7/15 |
| | AMERICAN AIRLINES/AADVAN | 5.5 | 100 | 103 | 11,794 | 2026/4/20 |
| | AMERICAN AIRLINES/AADVAN | 5.75 | 100 | 106 | 12,127 | 2029/4/20 |
| | AMERIGAS PART/FIN CORP | 5.75 | 175 | 194 | 22,096 | 2027/5/20 |
| | AMN HEALTHCARE INC | 4.0 | 175 | 177 | 20,206 | 2029/4/15 |
| | AMS AG | 7.0 | 200 | 210 | 23,947 | 2025/7/31 |
| | APACHE CORP | 4.875 | 125 | 135 | 15,350 | 2027/11/15 |
| | APACHE CORP | 4.375 | 100 | 107 | 12,173 | 2028/10/15 |
| | APACHE CORP | 4.25 | 100 | 106 | 12,118 | 2030/1/15 |
| | APACHE CORP | 4.75 | 75 | 82 | 9,339 | 2043/4/15 |
| | APPVION ESCROW | — | 350 | 0.875 | 99 | 2022/6/1 |
| | ARCHES BUYER INC | 4.25 | 50 | 49 | 5,647 | 2028/6/1 |
| | ARCHES BUYER INC | 6.125 | 175 | 177 | 20,210 | 2028/12/1 |
| | ARCHROCK PARTNERS LP/FIN | 6.875 | 125 | 130 | 14,852 | 2027/4/1 |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|--------------------------|--------------------------|-------|-------|--------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | ARCHROCK PARTNERS LP/FIN | 6.25 | 200 | 207 | 23,569 | 2028/4/1 |
| | ARCONIC INC | 5.9 | 250 | 281 | 31,918 | 2027/2/1 |
| | ARD FINANCE SA | 6.5 | 200 | 205 | 23,316 | 2027/6/30 |
| | ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA | 5.25 | 400 | 402 | 45,761 | 2027/8/15 |
| | ARKO CORP | 5.125 | 50 | 48 | 5,502 | 2029/11/15 |
| | ASBURY AUTOMOTIVE GROUP | 4.625 | 50 | 50 | 5,790 | 2029/11/15 |
| | ASBURY AUTOMOTIVE GROUP | 5.0 | 50 | 51 | 5,829 | 2032/2/15 |
| | ASCEND LEARNING LLC | 6.875 | 75 | 76 | 8,678 | 2025/8/1 |
| | ASCEND LEARNING LLC | 6.875 | 50 | 50 | 5,785 | 2025/8/1 |
| | ASCENT RESOURCES/ARU FIN | 7.0 | 100 | 101 | 11,552 | 2026/11/1 |
| | ASCENT RESOURCES/ARU FIN | 9.0 | 61 | 82 | 9,345 | 2027/11/1 |
| | ASCENT RESOURCES/ARU FIN | 8.25 | 100 | 106 | 12,126 | 2028/12/31 |
| | ASCENT RESOURCES/ARU FIN | 5.875 | 100 | 97 | 11,119 | 2029/6/30 |
| | ASHTON WOODS USA/FINANCE | 6.625 | 75 | 78 | 8,970 | 2028/1/15 |
| | ASHTON WOODS USA/FINANCE | 4.625 | 75 | 74 | 8,456 | 2029/8/1 |
| | ASHTON WOODS USA/FINANCE | 4.625 | 50 | 49 | 5,586 | 2030/4/1 |
| | ASP AMC MERGER SUB | 8.0 | 125 | 104 | 11,894 | 2025/5/15 |
| | ASSUREDPARTNERS INC | 7.0 | 200 | 201 | 22,854 | 2025/8/15 |
| | ASSUREDPARTNERS INC | 5.625 | 50 | 48 | 5,479 | 2029/1/15 |
| | ATLANTICA SUSTAIN INFRA | 4.125 | 200 | 201 | 22,863 | 2028/6/15 |
| | ATLAS LUXCO 4 / ALL UNI | 4.625 | 200 | 195 | 22,174 | 2028/6/1 |
| | AUSTIN BIDCO INC | 7.125 | 550 | 566 | 64,285 | 2028/12/15 |
| | AVANTOR FUNDING INC | 3.875 | 200 | 203 | 23,084 | 2029/11/1 |
| | AVENTINE ENERGY ESCROW | — | 2,850 | — | — | 2017/4/1 |
| | AVIS BUDGET CAR/FINANCE | 4.75 | 175 | 180 | 20,516 | 2028/4/1 |
| | AVIS BUDGET CAR/FINANCE | 5.375 | 100 | 104 | 11,888 | 2029/3/1 |
| | BAFFINLAND IRON CORP/LP | 8.75 | 200 | 209 | 23,742 | 2026/7/15 |
| | BASIC ENERGY SERVICES | — | 50 | 4 | 511 | 2023/10/15 |
| | BAUSCH HEALTH AMERICAS | 8.5 | 175 | 183 | 20,818 | 2027/1/31 |
| | BAUSCH HEALTH COS INC | 6.125 | 367 | 373 | 42,460 | 2025/4/15 |
| | BAUSCH HEALTH COS INC | 5.0 | 225 | 206 | 23,408 | 2028/1/30 |
| | BAUSCH HEALTH COS INC | 5.0 | 275 | 245 | 27,875 | 2029/2/15 |
| | BAUSCH HEALTH COS INC | 7.25 | 100 | 97 | 11,037 | 2029/5/30 |
| | BCPE EMPIRE HOLDINGS INC | 7.625 | 175 | 177 | 20,203 | 2027/5/1 |
| | BCPE ULYSSES INTERMEDIAT | 7.75 | 75 | 74 | 8,445 | 2027/4/1 |
| | BEAZER HOMES USA | 7.25 | 100 | 111 | 12,622 | 2029/10/15 |
| | BIG RIVER STEEL/BRS FIN | 6.625 | 200 | 217 | 24,701 | 2029/1/31 |
| | BLACKSTONE MORTGAGE TR | 3.75 | 425 | 420 | 47,739 | 2027/1/15 |
| | BOMBARDIER INC | 7.5 | 475 | 494 | 56,189 | 2024/12/1 |
| BONANZA CREEK ENERGY INC | 5.0 | 75 | 76 | 8,645 | 2026/10/15 | |
| BRAND ENERGY & INFRASTRU | 8.5 | 200 | 199 | 22,637 | 2025/7/15 | |
| BRISTOW GROUP INC | 6.875 | 200 | 205 | 23,301 | 2028/3/1 | |
| BROADSTREET PARTNERS INC | 5.875 | 50 | 49 | 5,578 | 2029/4/15 | |
| BROOKFIELD PPTY REIT INC | 4.5 | 100 | 97 | 11,096 | 2027/4/1 | |
| BUFFALO THUNDER DEV 144A | — | 1,052 | 536 | 60,934 | 2022/12/9 | |
| BUFFALO THUNDER DEV 144A | — | 466 | — | — | 2099/12/15 | |
| BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 5.0 | 100 | 108 | 12,291 | 2030/3/1 | |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 | |
|------|--------------------------|--------------------------|-------|-------|--------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 4.25 | 250 | 257 | 29,282 | 2032/2/1 |
| | | BWAY HOLDING CO | 7.25 | 400 | 398 | 45,255 | 2025/4/15 |
| | | CAESARS ENTERTAIN INC | 4.625 | 100 | 100 | 11,410 | 2029/10/15 |
| | | CALLON PETROLEUM | 8.0 | 175 | 178 | 20,300 | 2028/8/1 |
| | | CALLON PETROLEUM CO | 6.375 | 75 | 72 | 8,287 | 2026/7/1 |
| | | CALPINE CORP | 5.125 | 125 | 127 | 14,448 | 2028/3/15 |
| | | CALPINE CORP | 4.625 | 75 | 73 | 8,340 | 2029/2/1 |
| | | CAMELOT FINANCE SA | 4.5 | 175 | 182 | 20,722 | 2026/11/1 |
| | | CANO HEALTH LLC | 6.25 | 150 | 147 | 16,726 | 2028/10/1 |
| | | CARLSON TRAVEL INC | — | 201 | 12 | 1,428 | 2026/12/15 |
| | | CARLYLE AVIATION ELEVATE | 7.0 | 400 | 393 | 44,674 | 2024/10/15 |
| | | CARNIVAL CORP | 10.5 | 150 | 172 | 19,583 | 2026/2/1 |
| | | CARNIVAL CORP | 7.625 | 100 | 104 | 11,854 | 2026/3/1 |
| | | CARNIVAL CORP | 5.75 | 1,175 | 1,170 | 132,897 | 2027/3/1 |
| | | CARNIVAL CORP | 9.875 | 175 | 199 | 22,670 | 2027/8/1 |
| | | CARNIVAL CORP | 4.0 | 125 | 124 | 14,105 | 2028/8/1 |
| | | CARNIVAL CORP | 6.0 | 100 | 99 | 11,293 | 2029/5/1 |
| | | CARROLS RESTAURA | 5.875 | 50 | 45 | 5,126 | 2029/7/1 |
| | | CASTLE US HOLDING CORP | 9.5 | 250 | 262 | 29,790 | 2028/2/15 |
| | | CASTLELAKE AVIATION FIN | 5.0 | 275 | 270 | 30,737 | 2027/4/15 |
| | | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 5.375 | 25 | 26 | 3,058 | 2029/6/1 |
| | | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.75 | 250 | 262 | 29,770 | 2030/3/1 |
| | | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.5 | 450 | 464 | 52,720 | 2030/8/15 |
| | | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.25 | 100 | 101 | 11,562 | 2031/2/1 |
| | | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.5 | 225 | 230 | 26,227 | 2032/5/1 |
| | | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 4.5 | 75 | 76 | 8,712 | 2033/6/1 |
| | | CEDAR FAIR LP | 5.25 | 50 | 52 | 5,935 | 2029/7/15 |
| | | CEDAR FAIR/CAN/MAGNUM/MI | 6.5 | 100 | 107 | 12,153 | 2028/10/1 |
| | | CEMEX SAB DE CV | 5.45 | 200 | 216 | 24,580 | 2029/11/19 |
| | | CEMEX SAB DE CV | 3.875 | 200 | 200 | 22,718 | 2031/7/11 |
| | | CENTENE CORP | 3.375 | 225 | 229 | 26,103 | 2030/2/15 |
| | | CENTENE CORP | 3.0 | 75 | 76 | 8,643 | 2030/10/15 |
| | | CENTURY COMMUNITIES | 3.875 | 50 | 50 | 5,733 | 2029/8/15 |
| | | CENTURYLINK INC | 5.125 | 225 | 231 | 26,286 | 2026/12/15 |
| | | CENTURYLINK INC | 4.0 | 75 | 75 | 8,604 | 2027/2/15 |
| | | CHENIERE ENERGY INC | 4.625 | 250 | 261 | 29,744 | 2028/10/15 |
| | | CHENIERE ENERGY PARTNERS | 4.5 | 200 | 212 | 24,146 | 2029/10/1 |
| | | CHENIERE ENERGY PARTNERS | 4.0 | 250 | 261 | 29,643 | 2031/3/1 |
| | | CHENIERE ENERGY PARTNERS | 3.25 | 200 | 200 | 22,737 | 2032/1/31 |
| | | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 8.0 | 225 | 238 | 27,086 | 2026/3/15 |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 5.625 | 100 | 104 | 11,885 | 2027/3/15 | |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 8.0 | 215 | 231 | 26,284 | 2027/12/15 | |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 6.0 | 75 | 79 | 9,021 | 2029/1/15 | |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 6.875 | 225 | 230 | 26,199 | 2029/4/15 | |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 6.125 | 100 | 99 | 11,303 | 2030/4/1 | |
| | CHS/COMMUNITY HEALTH SYS | 4.75 | 125 | 125 | 14,298 | 2031/2/15 | |
| | CINEMARK USA INC | 5.875 | 125 | 126 | 14,396 | 2026/3/15 | |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 | |
|------|--------------------------|--------------------------|-------|-------|--------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | CINEMARK USA INC | 5.25 | 250 | 242 | 27,515 | 2028/7/15 |
| | | CITGO HOLDING INC | 9.25 | 225 | 223 | 25,343 | 2024/8/1 |
| | | CITGO PETROLEUM CORP | 7.0 | 175 | 177 | 20,148 | 2025/6/15 |
| | | CITGO PETROLEUM CORP | 6.375 | 150 | 151 | 17,199 | 2026/6/15 |
| | | CITIGROUP INC | 5.35 | 25 | 25 | 2,878 | 2049/5/29 |
| | | CITIGROUP INC | 4.7 | 225 | 227 | 25,847 | 2099/1/23 |
| | | CITIGROUP INC | 4.0 | 75 | 75 | 8,530 | 2099/12/10 |
| | | CLARIOS GLOBAL LP | 6.75 | 45 | 47 | 5,380 | 2025/5/15 |
| | | CLEAR CHANNEL OUTDOOR HO | 7.75 | 200 | 214 | 24,310 | 2028/4/15 |
| | | CLEAR CHANNEL OUTDOOR HO | 7.5 | 100 | 105 | 11,987 | 2029/6/1 |
| | | CLEARWAY ENERGY OP LLC | 4.75 | 225 | 238 | 27,109 | 2028/3/15 |
| | | CLEARWAY ENERGY OP LLC | 3.75 | 50 | 50 | 5,683 | 2031/2/15 |
| | | CLEARWAY ENERGY OP LLC | 3.75 | 50 | 49 | 5,629 | 2032/1/15 |
| | | CLEVELAND-CLIFFS INC | 5.875 | 150 | 156 | 17,771 | 2027/6/1 |
| | | CLEVELAND-CLIFFS INC | 4.625 | 150 | 153 | 17,470 | 2029/3/1 |
| | | CLEVELAND-CLIFFS INC | 4.875 | 125 | 129 | 14,752 | 2031/3/1 |
| | | CLEVELAND-CLIFFS INC | 6.25 | 25 | 26 | 3,063 | 2040/10/1 |
| | | CLOUD PEAK ENRGY | — | 300 | 1 | 187 | 2024/3/15 |
| | | CNX RESOURCES CORP | 7.25 | 275 | 292 | 33,179 | 2027/3/14 |
| | | CNX RESOURCES CORP | 6.0 | 100 | 103 | 11,769 | 2029/1/15 |
| | | COEUR MINING INC | 5.125 | 250 | 234 | 26,595 | 2029/2/15 |
| | | COINBASE GLOBAL INC | 3.375 | 50 | 46 | 5,334 | 2028/10/1 |
| | | COINBASE GLOBAL INC | 3.625 | 250 | 233 | 26,566 | 2031/10/1 |
| | | COLGATE ENERGY P | 5.875 | 125 | 128 | 14,569 | 2029/7/1 |
| | | COLT MERGER SUB INC | 6.25 | 175 | 183 | 20,886 | 2025/7/1 |
| | | COLT MERGER SUB INC | 8.125 | 175 | 193 | 21,961 | 2027/7/1 |
| | | COMMSCOPE INC | 4.75 | 50 | 49 | 5,588 | 2029/9/1 |
| | | COMMSCOPE TECH FINANCE L | 6.0 | 313 | 311 | 35,324 | 2025/6/15 |
| | | COMPASS MINERALS INTERNA | 6.75 | 100 | 104 | 11,886 | 2027/12/1 |
| | | COMSTOCK RESOURCES INC | 5.875 | 275 | 278 | 31,660 | 2030/1/15 |
| | | CONSENSUS CLOUD SOLUTION | 6.0 | 100 | 101 | 11,545 | 2026/10/15 |
| | | CONSENSUS CLOUD SOLUTION | 6.5 | 100 | 102 | 11,644 | 2028/10/15 |
| | | CONSOLIDATED ENERGY FIN | 6.5 | 150 | 153 | 17,441 | 2026/5/15 |
| | | CONSTELLIUM SE | 3.75 | 250 | 244 | 27,729 | 2029/4/15 |
| | | COOKE OMEGA/ALPHA VESSEL | 8.5 | 175 | 178 | 20,319 | 2022/12/15 |
| | | COOPER-STANDARD AUTOMOTI | 5.625 | 150 | 126 | 14,337 | 2026/11/15 |
| | | CP ATLAS BUYER INC | 7.0 | 225 | 223 | 25,341 | 2028/12/1 |
| | | CQP HOLDCO LP/BIP-V CHIN | 5.5 | 500 | 520 | 59,123 | 2031/6/15 |
| | | CRESTWOOD MID PARTNER LP | 5.75 | 75 | 75 | 8,623 | 2025/4/1 |
| | | CRESTWOOD MID PARTNER LP | 5.625 | 175 | 176 | 20,077 | 2027/5/1 |
| | CRESTWOOD MID PARTNER LP | 6.0 | 175 | 178 | 20,264 | 2029/2/1 | |
| | CROWNROCK LP/CROWNROCK F | 5.625 | 325 | 330 | 37,548 | 2025/10/15 | |
| | CROWNROCK LP/CROWNROCK F | 5.0 | 75 | 75 | 8,596 | 2029/5/1 | |
| | CSC HOLDINGS LLC | 7.5 | 250 | 269 | 30,624 | 2028/4/1 | |
| | CSC HOLDINGS LLC | 5.75 | 450 | 455 | 51,680 | 2030/1/15 | |
| | CSC HOLDINGS LLC | 4.5 | 200 | 198 | 22,526 | 2031/11/15 | |
| | DAVITA INC | 4.625 | 300 | 305 | 34,660 | 2030/6/1 | |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 | |
|-------------------------|--------------------------|-------------------------|-------|--------|-----------|------------|-----------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | DCP MIDSTREAM OPERATING | 5.125 | 625 | 697 | 79,259 | 2029/5/15 |
| | DELEK LOGISTICS PARTNERS | 6.75 | 275 | 280 | 31,834 | 2025/5/15 | |
| | DELTA AIR LINES INC | 7.375 | 50 | 58 | 6,633 | 2026/1/15 | |
| | DELTA AIR LINES/SKYMILES | 4.75 | 100 | 110 | 12,526 | 2028/10/20 | |
| | DIAMOND SPORTS GR/DIAMON | 6.625 | 250 | 64 | 7,362 | 2027/8/15 | |
| | DIEBOLD INC | 8.5 | 200 | 201 | 22,875 | 2024/4/15 | |
| | DIEBOLD NIXDORF INC | 9.375 | 25 | 26 | 3,028 | 2025/7/15 | |
| | DIGICEL GROUP 0.5 LTD | 8.0 | 420 | 421 | 47,870 | 2024/4/1 | |
| | DIRECTV HOLDINGS/FING | 5.875 | 250 | 256 | 29,120 | 2027/8/15 | |
| | DISH DBS CORP | 5.25 | 200 | 202 | 22,962 | 2026/12/1 | |
| | DISH DBS CORP | 7.375 | 100 | 101 | 11,542 | 2028/7/1 | |
| | DISH DBS CORP | 5.75 | 150 | 151 | 17,152 | 2028/12/1 | |
| | DISH DBS CORP | 5.125 | 125 | 113 | 12,937 | 2029/6/1 | |
| | DORNOCH DEBT MERGER SUB | 6.625 | 250 | 246 | 28,002 | 2029/10/15 | |
| | DOWNSTREAM DEVELOPMENT | 10.5 | 100 | 104 | 11,825 | 2023/2/15 | |
| | EDGEWELL PERSONAL CARE | 5.5 | 150 | 159 | 18,153 | 2028/6/1 | |
| | EDGEWELL PERSONAL CARE | 4.125 | 125 | 125 | 14,255 | 2029/4/1 | |
| | EMBARQ CORP | 7.995 | 150 | 167 | 18,990 | 2036/6/1 | |
| | EMPIRE COMMUNITIES CORP | 7.0 | 100 | 102 | 11,690 | 2025/12/15 | |
| | ENDO LUX FIN CO I SARL | 6.125 | 100 | 99 | 11,243 | 2029/4/1 | |
| | ENDURANCE ACQ MERGER | 6.0 | 325 | 301 | 34,205 | 2029/2/15 | |
| | ENERGEAN ISRAEL FINANCE | 5.375 | 50 | 48 | 5,550 | 2028/3/30 | |
| | ENERGEAN ISRAEL FINANCE | 5.875 | 50 | 48 | 5,511 | 2031/3/30 | |
| | ENLINK MIDSTREAM PARTNER | 4.85 | 200 | 205 | 23,342 | 2026/7/15 | |
| | ENLINK MIDSTREAM PARTNER | 5.6 | 75 | 72 | 8,196 | 2044/4/1 | |
| | ENLINK MIDSTREAM PARTNER | 5.05 | 175 | 161 | 18,383 | 2045/4/1 | |
| | ENLINK MIDSTREAM PARTNER | 5.45 | 25 | 24 | 2,766 | 2047/6/1 | |
| | ENTERPRISE MERGER SUB IN | 8.75 | 100 | 59 | 6,743 | 2026/10/15 | |
| | EQM MIDSTREAM PARTNERS L | 4.0 | 75 | 77 | 8,826 | 2024/8/1 | |
| | EQM MIDSTREAM PARTNERS L | 6.0 | 100 | 105 | 11,999 | 2025/7/1 | |
| | EQM MIDSTREAM PARTNERS L | 6.5 | 100 | 108 | 12,336 | 2027/7/1 | |
| | EQM MIDSTREAM PARTNERS L | 4.5 | 100 | 100 | 11,433 | 2029/1/15 | |
| | EQT CORP | 7.5 | 150 | 192 | 21,837 | 2030/2/1 | |
| | EVERI HOLDINGS INC | 5.0 | 50 | 50 | 5,727 | 2029/7/15 | |
| | EXELA INTERMED/EXELA FIN | 10.0 | 125 | 98 | 11,237 | 2023/7/15 | |
| | EXTERRAN NRG SOLUTIONS/F | 8.125 | 375 | 352 | 39,981 | 2025/5/1 | |
| | F-BRASILE SPA/F-BRASILE | 7.375 | 200 | 198 | 22,513 | 2026/8/15 | |
| | FERRELLGAS ESCROW LLC/FG | 5.375 | 175 | 165 | 18,781 | 2026/4/1 | |
| | FERRELLGAS ESCROW LLC/FG | 5.875 | 175 | 163 | 18,593 | 2029/4/1 | |
| | FIRSTENERGY CORP | 4.4 | 100 | 106 | 12,132 | 2027/7/15 | |
| FLEX ACQUISITION CO INC | 6.875 | 75 | 75 | 8,532 | 2025/1/15 | | |
| FLEX ACQUISITION CO INC | 7.875 | 125 | 129 | 14,715 | 2026/7/15 | | |
| FMG RESOURCES AUG 2006 | 4.375 | 175 | 180 | 20,513 | 2031/4/1 | | |
| FONTAINEBLEAU LAS VEGAS | — | 11,815 | 30 | 3,488 | 2015/6/15 | | |
| FORD MOTOR COMPANY | 9.0 | 400 | 487 | 55,421 | 2025/4/22 | | |
| FORD MOTOR COMPANY | 9.625 | 75 | 110 | 12,501 | 2030/4/22 | | |
| FORD MOTOR COMPANY | 3.25 | 100 | 102 | 11,644 | 2032/2/12 | | |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 | |
|--------------------------|--------------------------|--------------------|------|--------|------------|------------|-----------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| アメリカ | 普通社債券 (含む投資法人債券) | FORD MOTOR COMPANY | 4.75 | 200 | 220 | 24,985 | 2043/1/15 |
| | FORD MOTOR CREDI | 3.625 | 200 | 209 | 23,774 | 2031/6/17 | |
| | FORD MOTOR CREDIT CO LLC | 5.125 | 200 | 219 | 24,928 | 2025/6/16 | |
| | FORD MOTOR CREDIT CO LLC | 4.134 | 200 | 212 | 24,154 | 2025/8/4 | |
| | FORD MOTOR CREDIT CO LLC | 3.375 | 200 | 207 | 23,617 | 2025/11/13 | |
| | FORD MOTOR CREDIT CO LLC | 5.113 | 600 | 681 | 77,426 | 2029/5/3 | |
| | FORESTAR GROUP INC | 3.85 | 100 | 100 | 11,359 | 2026/5/15 | |
| | FORESTAR GROUP INC | 5.0 | 75 | 77 | 8,746 | 2028/3/1 | |
| | FORTRESS TRANS & INFRAST | 6.5 | 225 | 230 | 26,215 | 2025/10/1 | |
| | FORTRESS TRANS & INFRAST | 5.5 | 100 | 99 | 11,280 | 2028/5/1 | |
| | FOUNDATION BUILDING M | 6.0 | 100 | 97 | 11,066 | 2029/3/1 | |
| | FOXTROT ESCROW ISSUER | 12.25 | 198 | 222 | 25,264 | 2026/11/15 | |
| | FREEDOM MORTGAGE | 6.625 | 125 | 121 | 13,762 | 2027/1/15 | |
| | FREEDOM MORTGAGE CORP | 7.625 | 200 | 199 | 22,694 | 2026/5/1 | |
| | FREEPORT-MCMORAN C & G | 5.45 | 100 | 125 | 14,260 | 2043/3/15 | |
| | FREEPORT-MCMORAN INC | 4.125 | 325 | 338 | 38,448 | 2028/3/1 | |
| | FREEPORT-MCMORAN INC | 4.375 | 100 | 104 | 11,883 | 2028/8/1 | |
| | FREEPORT-MCMORAN INC | 4.25 | 350 | 368 | 41,894 | 2030/3/1 | |
| | FREEPORT-MCMORAN INC | 4.625 | 100 | 108 | 12,290 | 2030/8/1 | |
| | FRONTIER COMMUNICATIONS | 5.875 | 50 | 52 | 5,976 | 2027/10/15 | |
| | FRONTIER COMMUNICATIONS | 5.0 | 75 | 77 | 8,768 | 2028/5/1 | |
| | FRONTIER COMMUNICATIONS | 6.75 | 125 | 130 | 14,799 | 2029/5/1 | |
| | FRONTIER COMMUNICATIONS | 5.875 | 39 | 39 | 4,490 | 2029/11/1 | |
| | FRONTIER COMMUNICATIONS | 6.0 | 125 | 126 | 14,359 | 2030/1/15 | |
| | GARDA WORLD SECURITY | 6.0 | 225 | 218 | 24,764 | 2029/6/1 | |
| | GENWORTH MORTGAGE HLDING | 6.5 | 100 | 109 | 12,410 | 2025/8/15 | |
| | GEO GROUP INC/THE | 6.0 | 100 | 85 | 9,765 | 2026/4/15 | |
| | GLOBAL AIR LEASE CO LTD | 6.5 | 754 | 729 | 82,832 | 2024/9/15 | |
| | GO DADDY OPKO/FINCO | 3.5 | 125 | 122 | 13,868 | 2029/3/1 | |
| | GOLDEN ENTERTAINMENT INC | 7.625 | 150 | 156 | 17,785 | 2026/4/15 | |
| | GOLDEN NUGGET INC | 6.75 | 350 | 350 | 39,785 | 2024/10/15 | |
| | GOLDEN NUGGET INC | 8.75 | 75 | 77 | 8,836 | 2025/10/1 | |
| | GOODYEAR TIRE & RUBBER | 5.0 | 100 | 105 | 12,027 | 2029/7/15 | |
| | GOODYEAR TIRE & RUBBER | 5.25 | 150 | 160 | 18,190 | 2031/7/15 | |
| | GPS HOSPITALITY HOLDING | 7.0 | 150 | 137 | 15,615 | 2028/8/15 | |
| | GRAHAM HOLDINGS CO | 5.75 | 125 | 130 | 14,803 | 2026/6/1 | |
| | GRANITE HOLDINGS US ACQU | 11.0 | 300 | 327 | 37,182 | 2027/10/1 | |
| | GRAY ESCROW INC | 7.0 | 75 | 80 | 9,117 | 2027/5/15 | |
| | GRAY TELEVISION INC | 4.75 | 100 | 98 | 11,191 | 2030/10/15 | |
| | GROUP 1 AUTOMOTIVE INC | 4.0 | 225 | 225 | 25,572 | 2028/8/15 | |
| GULFPORT ENERGY CORP | 8.0 | 65 | 71 | 8,146 | 2026/5/17 | | |
| GULFPORT ENERGY ESCROW | — | 25 | 0.75 | 85 | 2024/10/15 | | |
| GULFPORT ENERGY ESCROW | — | 200 | 6 | 681 | 2025/5/15 | | |
| HARVEST MIDSTREAM I LP | 7.5 | 250 | 259 | 29,494 | 2028/9/1 | | |
| HAT HOLDINGS I LLC/HAT | 3.375 | 100 | 100 | 11,373 | 2026/6/15 | | |
| HAT HOLDINGS I LLC/HAT | 3.75 | 300 | 297 | 33,781 | 2030/9/15 | | |
| HAWAIIAN BRAND INTELLECT | 5.75 | 200 | 206 | 23,452 | 2026/1/20 | | |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|-------|-------|-------|--------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | HCA INC | 7.69 | 150 | 176 | 20,009 | 2025/6/15 |
| | HCA INC | 7.58 | 150 | 177 | 20,120 | 2025/9/15 |
| | HCA INC | 5.875 | 50 | 56 | 6,409 | 2026/2/15 |
| | HELLAS II | — | 5,050 | — | — | 2015/1/15 |
| | HERTZ CORP/THE | 4.625 | 50 | 50 | 5,708 | 2026/12/1 |
| | HERTZ CORP/THE | 5.0 | 75 | 75 | 8,531 | 2029/12/1 |
| | HESS MIDSTREAM | 5.625 | 150 | 155 | 17,619 | 2026/2/15 |
| | HESS MIDSTREAM PARTNERS | 5.125 | 175 | 180 | 20,488 | 2028/6/15 |
| | HILCORP ENERGY I/HILCORP | 5.75 | 100 | 101 | 11,517 | 2029/2/1 |
| | HILCORP ENERGY I/HILCORP | 6.0 | 125 | 127 | 14,497 | 2031/2/1 |
| | HILTON DOMESTIC OPERATIN | 5.75 | 75 | 80 | 9,147 | 2028/5/1 |
| | HILTON DOMESTIC OPERATIN | 3.75 | 50 | 50 | 5,779 | 2029/5/1 |
| | HILTON DOMESTIC OPERATIN | 4.875 | 100 | 107 | 12,236 | 2030/1/15 |
| | HILTON GRAND VAC BOR ESC | 5.0 | 225 | 226 | 25,776 | 2029/6/1 |
| | HILTON GRAND VAC BOR ESC | 4.875 | 150 | 150 | 17,118 | 2031/7/1 |
| | HJ HEINZ CO | 5.2 | 75 | 96 | 10,920 | 2045/7/15 |
| | HOSPITALITY PROP TRUST | 4.35 | 150 | 147 | 16,769 | 2024/10/1 |
| | HUB INTERNATIONAL LTD | 7.0 | 175 | 180 | 20,468 | 2026/5/1 |
| | HUB INTERNATIONAL LTD | 5.625 | 100 | 101 | 11,482 | 2029/12/1 |
| | HUSKY III HOLDING LTD | 13.0 | 100 | 105 | 11,986 | 2025/2/15 |
| | IAMGOLD CORP | 5.75 | 150 | 147 | 16,725 | 2028/10/15 |
| | ICAHN ENTERPRISES/FIN | 4.75 | 125 | 126 | 14,392 | 2024/9/15 |
| | ICAHN ENTERPRISES/FIN | 6.25 | 450 | 468 | 53,244 | 2026/5/15 |
| | ICAHN ENTERPRISES/FIN | 5.25 | 75 | 77 | 8,781 | 2027/5/15 |
| | ICAHN ENTERPRISES/FIN | 4.375 | 100 | 98 | 11,195 | 2029/2/1 |
| | IHEARTCOMMUNICATIONS INC | 6.375 | 52 | 55 | 6,291 | 2026/5/1 |
| | IHEARTCOMMUNICATIONS INC | 4.75 | 125 | 124 | 14,190 | 2028/1/15 |
| | ILFC E-CAPITAL TRUST I | 3.46 | 220 | 181 | 20,587 | 2065/12/21 |
| | ILIAD HOLDING SAS | 7.0 | 200 | 208 | 23,731 | 2028/10/15 |
| | IMOLA MERGER CORP | 4.75 | 350 | 359 | 40,869 | 2029/5/15 |
| | INN OF THE MOUNTAIN GODS | 9.25 | 91 | 90 | 10,272 | 2023/11/30 |
| | INTEL PKG HOLDCO ISSUER | 9.0 | 50 | 52 | 5,934 | 2026/1/15 |
| | INTELSAT JACKSON HLDG | — | 300 | 146 | 16,668 | 2025/7/15 |
| | INTELSAT LUXEMBOURG SA | — | 225 | 1 | 159 | 2023/6/1 |
| | IRB HOLDING CORP | 6.75 | 125 | 128 | 14,548 | 2026/2/15 |
| | IRIS HOLDINGS INC | 8.75 | 75 | 76 | 8,632 | 2026/2/15 |
| | IRIS MERGER SUB 2019 INC | 9.375 | 300 | 323 | 36,744 | 2028/2/15 |
| | IRON MOUNTAIN INC | 4.875 | 275 | 281 | 31,957 | 2029/9/15 |
| | IRON MOUNTAIN INC | 5.25 | 150 | 156 | 17,780 | 2030/7/15 |
| | ITHACA ENERGY NORTH | 9.0 | 200 | 205 | 23,289 | 2026/7/15 |
| | J2 GLOBAL | 4.625 | 174 | 175 | 19,988 | 2030/10/15 |
| | JACOBS ENTERTAINMENT INC | 7.875 | 225 | 230 | 26,172 | 2024/2/1 |
| | JAGUAR LAND ROVER AUTOMO | 7.75 | 200 | 216 | 24,594 | 2025/10/15 |
| | JAGUAR LAND ROVER AUTOMO | 5.5 | 200 | 196 | 22,336 | 2029/7/15 |
| | JAZZ SECURITIES DAC | 4.375 | 200 | 207 | 23,535 | 2029/1/15 |
| | JBS USA/FOOD/FINANCE | 6.5 | 175 | 193 | 21,993 | 2029/4/15 |
| | JBS USA/FOOD/FINANCE | 5.5 | 175 | 190 | 21,613 | 2030/1/15 |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|-------|------|---------|--------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | JBS USA/FOOD/FINANCE | 3.75 | 75 | 77 | 8,765 | 2031/12/1 |
| | JC PENNEY CORP INC | — | 124 | 0.01247 | 1 | 2025/3/15 |
| | JPMORGAN CHASE & CO | 6.75 | 150 | 161 | 18,332 | 2049/1/29 |
| | JPMORGAN CHASE & CO | 4.6 | 100 | 101 | 11,484 | 2099/1/23 |
| | K HOVNIANIAN ENTERPRISES | 13.5 | 79 | 83 | 9,465 | 2026/2/1 |
| | K HOVNIANIAN ENTERPRISES | 5.0 | 79 | 57 | 6,504 | 2040/2/1 |
| | KAISER ALUMINUM CORP | 4.625 | 175 | 175 | 19,897 | 2028/3/1 |
| | KB HOME | 6.875 | 75 | 88 | 10,010 | 2027/6/15 |
| | KB HOME | 4.8 | 100 | 108 | 12,345 | 2029/11/15 |
| | KB HOME | 4.0 | 100 | 102 | 11,680 | 2031/6/15 |
| | KEN GARFF AUTOMOTIVE LLC | 4.875 | 275 | 274 | 31,127 | 2028/9/15 |
| | KRAFT HEINZ FOODS CO | 5.0 | 55 | 67 | 7,711 | 2035/7/15 |
| | KRAFT HEINZ FOODS CO | 4.875 | 75 | 94 | 10,737 | 2049/10/1 |
| | L BRANDS INC | 9.375 | 15 | 18 | 2,089 | 2025/7/1 |
| | L BRANDS INC | 7.5 | 50 | 56 | 6,462 | 2029/6/15 |
| | L BRANDS INC | 6.625 | 100 | 113 | 12,895 | 2030/10/1 |
| | L BRANDS INC | 6.75 | 225 | 277 | 31,494 | 2036/7/1 |
| | LABL INC | 5.875 | 25 | 25 | 2,856 | 2028/11/1 |
| | LABL INC | 8.25 | 75 | 73 | 8,299 | 2029/11/1 |
| | LADDER CAP FIN LLLP/CORP | 4.25 | 75 | 75 | 8,519 | 2027/2/1 |
| | LADDER CAP FIN LLLP/CORP | 4.75 | 50 | 50 | 5,752 | 2029/6/15 |
| | LAMAR MEDIA CORP | 4.875 | 300 | 315 | 35,790 | 2029/1/15 |
| | LAREDO PETROLEUM INC | 9.5 | 300 | 308 | 35,018 | 2025/1/15 |
| | LAREDO PETROLEUM INC | 7.75 | 175 | 172 | 19,621 | 2029/7/31 |
| | LBM ACQUISITION LLC | 6.25 | 100 | 99 | 11,293 | 2029/1/15 |
| | LEEWARD RENEWABL | 4.25 | 275 | 277 | 31,520 | 2029/7/1 |
| | LEVEL 3 FINANCING INC | 4.25 | 325 | 324 | 36,871 | 2028/7/1 |
| | LEVEL 3 FINANCING INC | 3.75 | 75 | 72 | 8,191 | 2029/7/15 |
| | LIFE TIME INC | 5.75 | 200 | 206 | 23,493 | 2026/1/15 |
| | LIFE TIME INC | 8.0 | 275 | 286 | 32,568 | 2026/4/15 |
| | LITHIA MOTORS INC | 3.875 | 325 | 332 | 37,807 | 2029/6/1 |
| | LOGAN MERGER SUB INC | 5.5 | 325 | 329 | 37,410 | 2027/9/1 |
| | LSF11 A5 HOLDCO LLC | 6.625 | 25 | 24 | 2,786 | 2029/10/15 |
| | LSF9 ATL HLDG/VICTRA FIN | 7.75 | 350 | 355 | 40,364 | 2026/2/15 |
| | LUMEN TECHNOLOGIES INC | 5.375 | 100 | 99 | 11,270 | 2029/6/15 |
| | MACY'S RETAIL HLDGS LLC | 5.875 | 275 | 295 | 33,538 | 2029/4/1 |
| | MACY'S RETAIL HLDGS LLC | 5.125 | 75 | 72 | 8,232 | 2042/1/15 |
| | MADISON IAQ LLC | 4.125 | 50 | 50 | 5,716 | 2028/6/30 |
| | MADISON IAQ LLC | 5.875 | 50 | 48 | 5,561 | 2029/6/30 |
| | MAGIC MERGERCO INC | 5.25 | 100 | 101 | 11,485 | 2028/5/1 |
| | MAGIC MERGERCO INC | 7.875 | 150 | 153 | 17,376 | 2029/5/1 |
| | MALLINCKRODT FIN/SB | — | 150 | 88 | 10,081 | 2023/10/15 |
| | MATTAMY GROUP CORP | 4.625 | 125 | 125 | 14,251 | 2030/3/1 |
| | MATTEL INC | 3.375 | 50 | 51 | 5,873 | 2026/4/1 |
| | MATTEL INC | 3.75 | 50 | 51 | 5,875 | 2029/4/1 |
| | MATTHEWS INTERNATIONAL C | 5.25 | 125 | 128 | 14,587 | 2025/12/1 |
| | MAV ACQUISITION CORP | 8.0 | 125 | 122 | 13,963 | 2029/8/1 |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|-------|-------|---------|--------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | MEG ENERGY CORP | 7.125 | 200 | 210 | 23,935 | 2027/2/1 |
| | MEG ENERGY CORP | 5.875 | 50 | 51 | 5,831 | 2029/2/1 |
| | MERISANT ESCROW | 12.25 | 4,750 | — | — | 2014/5/15 |
| | MERITAGE HOMES CORP | 3.875 | 200 | 209 | 23,771 | 2029/4/15 |
| | MGIC INVESTMENT CORP | 5.25 | 450 | 473 | 53,783 | 2028/8/15 |
| | MGM RESORTS INTL | 5.5 | 164 | 175 | 19,891 | 2027/4/15 |
| | MIDAS INT HOLDCO II/FIN | 7.875 | 375 | 373 | 42,404 | 2022/10/1 |
| | MIDWEST VANADIUM PTY LTD | — | 186 | 0.27968 | 31 | 2023/2/15 |
| | MIRABELA NICKEL LTD SUBO | — | 5 | — | — | 2044/9/10 |
| | MOHEGAN GAMING & ENT | 8.0 | 300 | 304 | 34,575 | 2026/2/1 |
| | MOHEGAN TRIBAL GAMING AU | 7.875 | 125 | 130 | 14,770 | 2024/10/15 |
| | MOLINA HEALTHCARE INC | 3.875 | 275 | 277 | 31,549 | 2032/5/15 |
| | MOTION BONDCO DAC | 6.625 | 200 | 202 | 22,975 | 2027/11/15 |
| | MOUNTAIN PROVINCE DIAMON | 8.0 | 75 | 69 | 7,875 | 2022/12/15 |
| | MOZART DEBT MERGER SUB | 3.875 | 300 | 300 | 34,098 | 2029/4/1 |
| | MOZART DEBT MERGER SUB | 5.25 | 150 | 152 | 17,280 | 2029/10/1 |
| | MPH ACQUISITION HOLDINGS | 5.5 | 25 | 24 | 2,835 | 2028/9/1 |
| | MPH ACQUISITION HOLDINGS | 5.75 | 225 | 209 | 23,761 | 2028/11/1 |
| | MPT OPER PARTNERSP/FINL | 4.625 | 175 | 185 | 21,027 | 2029/8/1 |
| | MPT OPER PARTNERSP/FINL | 3.5 | 100 | 100 | 11,445 | 2031/3/15 |
| | MURPHY OIL CORP | 5.875 | 200 | 207 | 23,537 | 2027/12/1 |
| | NABORS INDUSTRIES INC | 5.75 | 125 | 110 | 12,541 | 2025/2/1 |
| | NABORS INDUSTRIES INC | 7.375 | 50 | 50 | 5,784 | 2027/5/15 |
| | NABORS INDUSTRIES LTD | 7.25 | 200 | 179 | 20,422 | 2026/1/15 |
| | NABORS INDUSTRIES LTD | 7.5 | 75 | 66 | 7,566 | 2028/1/15 |
| | NATIONSTAR MTG HLD INC | 6.0 | 50 | 51 | 5,864 | 2027/1/15 |
| | NATIONSTAR MTG HLD INC | 5.5 | 125 | 128 | 14,541 | 2028/8/15 |
| | NATIONSTAR MTG HLD INC | 5.125 | 100 | 98 | 11,173 | 2030/12/15 |
| | NATIONSTAR MTG HLD INC | 5.75 | 50 | 49 | 5,664 | 2031/11/15 |
| | NAVIENT CORP | 5.875 | 250 | 264 | 30,034 | 2024/10/25 |
| | NAVIENT CORP | 6.75 | 50 | 54 | 6,191 | 2025/6/25 |
| | NAVIENT CORP | 6.75 | 150 | 164 | 18,682 | 2026/6/15 |
| | NAVIENT CORP | 5.5 | 125 | 125 | 14,301 | 2029/3/15 |
| | NCL CORPORATION LTD | 12.25 | 33 | 39 | 4,451 | 2024/5/15 |
| | NCL CORPORATION LTD | 10.25 | 65 | 74 | 8,517 | 2026/2/1 |
| | NCL CORPORATION LTD | 5.875 | 275 | 269 | 30,648 | 2026/3/15 |
| | NCL FINANCE LTD | 6.125 | 100 | 98 | 11,167 | 2028/3/15 |
| | NCR CORP | 5.75 | 175 | 183 | 20,843 | 2027/9/1 |
| | NCR CORP | 5.0 | 100 | 101 | 11,562 | 2028/10/1 |
| | NCR CORP | 5.125 | 250 | 257 | 29,228 | 2029/4/15 |
| | NCR CORP | 6.125 | 175 | 187 | 21,293 | 2029/9/1 |
| | NEW ENTERPRISE STONE & L | 9.75 | 250 | 268 | 30,536 | 2028/7/15 |
| | NEW ENTERPRISE STONE & L | 5.25 | 100 | 101 | 11,533 | 2028/7/15 |
| | NEWELL RUBBERMAID INC | 6.0 | 75 | 94 | 10,769 | 2046/4/1 |
| | NEWS CORP | 3.875 | 325 | 325 | 36,974 | 2029/5/15 |
| | NEXSTAR BROADCASTING INC | 4.75 | 150 | 152 | 17,297 | 2028/11/1 |
| | NEXTERA ENERGY OPERATING | 4.25 | 12 | 12 | 1,398 | 2024/9/15 |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|-------|------|-------|--------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | NEXTERA ENERGY OPERATING | 3.875 | 150 | 158 | 17,954 | 2026/10/15 |
| | NFP CORP | 6.875 | 325 | 328 | 37,320 | 2028/8/15 |
| | NFP CORP | 4.875 | 50 | 50 | 5,716 | 2028/8/15 |
| | NGL ENRGY OP/FIN CORP | 7.5 | 225 | 227 | 25,841 | 2026/2/1 |
| | NINE ENERGY SERVICE INC | 8.75 | 50 | 24 | 2,791 | 2023/11/1 |
| | NMI HOLDINGS | 7.375 | 275 | 312 | 35,445 | 2025/6/1 |
| | NORTHERN OIL AND GAS INC | 8.125 | 250 | 267 | 30,344 | 2028/3/1 |
| | NORTHWEST ACQ/DOMINION | — | 100 | 0.006 | 0.681 | 2022/11/1 |
| | NOVELIS CORP | 4.75 | 275 | 282 | 32,134 | 2030/1/30 |
| | NRG ENERGY INC | 6.625 | 30 | 31 | 3,526 | 2027/1/15 |
| | NRG ENERGY INC | 3.375 | 75 | 72 | 8,276 | 2029/2/15 |
| | NRG ENERGY INC | 5.25 | 175 | 183 | 20,793 | 2029/6/15 |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM | 3.4 | 175 | 177 | 20,149 | 2026/4/15 |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 6.95 | 25 | 27 | 3,127 | 2024/7/1 |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 3.45 | 175 | 181 | 20,566 | 2024/7/15 |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 8.0 | 50 | 58 | 6,623 | 2025/7/15 |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 5.875 | 200 | 221 | 25,105 | 2025/9/1 |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 5.55 | 100 | 110 | 12,552 | 2026/3/15 |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 6.375 | 150 | 174 | 19,788 | 2028/9/1 |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 8.875 | 100 | 134 | 15,314 | 2030/7/15 |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 6.625 | 225 | 276 | 31,354 | 2030/9/1 |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 6.125 | 150 | 179 | 20,425 | 2031/1/1 |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 7.5 | 225 | 290 | 32,954 | 2031/5/1 |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 6.45 | 75 | 95 | 10,887 | 2036/9/15 |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM COR | 4.2 | 150 | 149 | 16,977 | 2048/3/15 |
| | OI EUROPEAN GROUP BV | 4.75 | 75 | 76 | 8,658 | 2030/2/15 |
| | OLIN CORP | 5.625 | 75 | 80 | 9,193 | 2029/8/1 |
| | OLIN CORP | 5.0 | 150 | 157 | 17,923 | 2030/2/1 |
| | OLYMPUS WTR US HLDG CORP | 4.25 | 200 | 195 | 22,226 | 2028/10/1 |
| | OLYMPUS WTR US HLDG CORP | 6.25 | 200 | 194 | 22,057 | 2029/10/1 |
| | OPEN TEXT HOLDINGS INC | 4.125 | 125 | 127 | 14,433 | 2030/2/15 |
| | OPEN TEXT/OPEN TEXT HOLD | 3.875 | 125 | 125 | 14,282 | 2029/12/1 |
| | OPEN TEXT/OPEN TEXT HOLD | 4.125 | 125 | 125 | 14,281 | 2031/12/1 |
| | ORGANON FINANCE 1 LLC | 5.125 | 200 | 208 | 23,650 | 2031/4/30 |
| | ORTHO-CLINICAL INC/SA | 7.375 | 60 | 63 | 7,180 | 2025/6/1 |
| | ORTHO-CLINICAL INC/SA | 7.25 | 75 | 79 | 9,084 | 2028/2/1 |
| | OT MERGER CORP | 7.875 | 50 | 48 | 5,528 | 2029/10/15 |
| | OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C | 4.25 | 125 | 122 | 13,895 | 2029/1/15 |
| | OXFORD FIN LLC/CO-ISS II | 6.375 | 125 | 125 | 14,209 | 2022/12/15 |
| | PACIFIC GAS & ELECTRIC | 4.55 | 250 | 272 | 31,001 | 2030/7/1 |
| | PANTHER BF AGGREGATOR 2 | 8.5 | 50 | 53 | 6,041 | 2027/5/15 |
| | PAR PHARMACEUTICAL INC | 7.5 | 175 | 179 | 20,388 | 2027/4/1 |
| | PARK RIVER HOLDINGS INC | 5.625 | 175 | 166 | 18,965 | 2029/2/1 |
| | PARK-OHIO INDUSTRIES INC | 6.625 | 275 | 260 | 29,626 | 2027/4/15 |
| | PARKLAND CORP/CANADA | 4.5 | 250 | 249 | 28,321 | 2029/10/1 |
| | PARKLAND CORP/CANADA | 4.625 | 75 | 75 | 8,548 | 2030/5/1 |
| | PARKLAND FUEL CORP | 5.875 | 100 | 106 | 12,049 | 2027/7/15 |

| 銘柄 | 柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|-------|------|-------|--------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | PATRICK INDUSTRIES INC | 7.5 | 175 | 186 | 21,146 | 2027/10/15 |
| | PATRICK INDUSTRIES INC | 4.75 | 100 | 98 | 11,177 | 2029/5/1 |
| | PATTERN ENERGY OP LP/PAT | 4.5 | 250 | 256 | 29,146 | 2028/8/15 |
| | PAYSAFE FIN PLC/PAYSAFE | 4.0 | 75 | 69 | 7,850 | 2029/6/15 |
| | PBF HOLDING CO LLC | 9.25 | 125 | 120 | 13,642 | 2025/5/15 |
| | PBF HOLDING CO LLC | 6.0 | 125 | 83 | 9,522 | 2028/2/15 |
| | PBF LOGISTICS LP/FINANCE | 6.875 | 245 | 235 | 26,748 | 2023/5/15 |
| | PECF USS INTERMEDIATE HO | 8.0 | 50 | 51 | 5,811 | 2029/11/15 |
| | PENN VIRGINIA ESC LLC | 9.25 | 100 | 104 | 11,825 | 2026/8/15 |
| | PENNYMAC FIN SVCS INC | 4.25 | 250 | 237 | 26,923 | 2029/2/15 |
| | PENNYMAC FIN SVCS INC | 5.75 | 50 | 50 | 5,712 | 2031/9/15 |
| | PETROBAKKEN ENERGY LTD | — | 450 | — | — | 2023/2/1 |
| | PG&E CORP | 5.0 | 275 | 286 | 32,524 | 2028/7/1 |
| | PG&E CORP | 5.25 | 150 | 156 | 17,745 | 2030/7/1 |
| | PGT INNOVATIONS INC | 4.375 | 75 | 75 | 8,571 | 2029/10/1 |
| | PM GENERAL PURCHASER LLC | 9.5 | 125 | 127 | 14,523 | 2028/10/1 |
| | POLAR US BORROWER LLC | 6.75 | 75 | 72 | 8,278 | 2026/5/15 |
| | PRECISION DRILLING CORP | 7.125 | 75 | 75 | 8,615 | 2026/1/15 |
| | PRECISION DRILLING CORP | 6.875 | 75 | 75 | 8,588 | 2029/1/15 |
| | PREMIER ENTERTAINMENT SU | 5.625 | 125 | 124 | 14,086 | 2029/9/1 |
| | PREMIER ENTERTAINMENT SU | 5.875 | 125 | 124 | 14,116 | 2031/9/1 |
| | PRIME SECSRVC BRW/FINANC | 5.25 | 75 | 80 | 9,113 | 2024/4/15 |
| | PRIME SECSRVC BRW/FINANC | 3.375 | 175 | 168 | 19,135 | 2027/8/31 |
| | PRIME SECSRVC BRW/FINANC | 6.25 | 75 | 77 | 8,764 | 2028/1/15 |
| | RADIAN GROUP INC | 6.625 | 25 | 27 | 3,126 | 2025/3/15 |
| | RADIAN GROUP INC | 4.875 | 125 | 132 | 15,097 | 2027/3/15 |
| | RANGE RESOURCES CORP | 8.25 | 125 | 138 | 15,776 | 2029/1/15 |
| | REALOGY GROUP/CO-ISSUER | 5.75 | 350 | 359 | 40,793 | 2029/1/15 |
| | ROCKCLIFF ENERGY II LLC | 5.5 | 75 | 76 | 8,710 | 2029/10/15 |
| | ROCKETMTGE CO-ISSUER INC | 2.875 | 50 | 49 | 5,650 | 2026/10/15 |
| | ROCKETMTGE CO-ISSUER INC | 4.0 | 50 | 50 | 5,704 | 2033/10/15 |
| | ROLLS-ROYCE PLC | 5.75 | 200 | 221 | 25,163 | 2027/10/15 |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 5.25 | 175 | 177 | 20,105 | 2022/11/15 |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 9.125 | 200 | 213 | 24,256 | 2023/6/15 |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 5.5 | 75 | 74 | 8,505 | 2026/8/31 |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 3.7 | 225 | 210 | 23,947 | 2028/3/15 |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES | 5.5 | 350 | 346 | 39,371 | 2028/4/1 |
| | RRI ENERGY ESCROW | — | 50 | — | — | 2027/6/15 |
| | SANCHEZ ENERGY CORP | — | 342 | 13 | 1,553 | 2021/6/15 |
| | SANCHEZ ENERGY CORP | — | 325 | 13 | 1,476 | 2023/1/15 |
| | SANJEL CORP | — | 200 | — | — | 2049/12/31 |
| | SANJEL CORP | — | 7 | — | — | 2049/12/31 |
| | SANJEL CORP ZCPN | — | 7 | — | — | 2049/12/31 |
| | SANJEL CORP ZCPN | — | 7 | — | — | 2049/12/31 |
| | SANJEL CORP ZCPN | — | 7 | — | — | 2049/12/31 |
| | SANJEL CORP ZCPN | — | 7 | — | — | 2049/12/31 |
| | SANJEL CORP ZCPN | — | 7 | — | — | 2049/12/31 |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|-------------------------|--------------------------|-------|------|--------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| アメリカ | 普通社債券 | | | | | |
| | (含む投資法人債券) | | | | | |
| | SANJEL CORP ZCPN | — | 7 | — | — | 2049/12/31 |
| | SANJEL CORP ZCPN | — | 7 | — | — | 2049/12/31 |
| | SBA COMMUNICATIONS CORP | 3.875 | 425 | 440 | 50,004 | 2027/2/15 |
| | SCIENTIFIC GAMES INTERNA | 8.25 | 100 | 105 | 11,992 | 2026/3/15 |
| | SCIENTIFIC GAMES INTERNA | 7.0 | 125 | 133 | 15,152 | 2028/5/15 |
| | SCIENTIFIC GAMES INTERNA | 7.25 | 75 | 83 | 9,524 | 2029/11/15 |
| | SCIH SALT HOLDINGS INC | 4.875 | 125 | 120 | 13,655 | 2028/5/1 |
| | SCIH SALT HOLDINGS INC | 6.625 | 150 | 143 | 16,251 | 2029/5/1 |
| | SCIL IV LLC / SCIL USA H | 5.375 | 325 | 329 | 37,454 | 2026/11/1 |
| | SEASpan CORP | 5.5 | 175 | 176 | 20,036 | 2029/8/1 |
| | SELECT MEDICAL CORP | 6.25 | 150 | 157 | 17,901 | 2026/8/15 |
| | SENSATA TECHNOLOGIES BV | 4.0 | 200 | 205 | 23,353 | 2029/4/15 |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 4.5 | 75 | 72 | 8,260 | 2025/3/15 |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 7.5 | 100 | 106 | 12,141 | 2025/9/15 |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 5.25 | 225 | 222 | 25,242 | 2026/2/15 |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 5.5 | 50 | 50 | 5,774 | 2027/12/15 |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 4.95 | 25 | 23 | 2,684 | 2029/10/1 |
| | SERVICE PROPERTIES TRUST | 4.375 | 150 | 137 | 15,576 | 2030/2/15 |
| | SHEA HOMES LP/FNDG CP | 4.75 | 75 | 76 | 8,658 | 2028/2/15 |
| | SHEA HOMES LP/FNDG CP | 4.75 | 75 | 75 | 8,631 | 2029/4/1 |
| | SHELF DRILL HOLD LTD | 8.875 | 100 | 102 | 11,619 | 2024/11/15 |
| | SHELF DRILL HOLD LTD | 8.25 | 175 | 124 | 14,192 | 2025/2/15 |
| | SINCLAIR TELEVISION GROU | 5.125 | 175 | 167 | 19,012 | 2027/2/15 |
| | SINCLAIR TELEVISION GROU | 5.5 | 75 | 71 | 8,161 | 2030/3/1 |
| | SINCLAIR TELEVISION GROU | 4.125 | 150 | 143 | 16,251 | 2030/12/1 |
| | SIRIUS XM RADIO INC | 5.5 | 200 | 215 | 24,510 | 2029/7/1 |
| | SM ENERGY CO | 6.625 | 350 | 357 | 40,605 | 2027/1/15 |
| | SONIC AUTOMOTIVE INC | 4.625 | 75 | 75 | 8,613 | 2029/11/15 |
| | SONIC AUTOMOTIVE INC | 4.875 | 75 | 75 | 8,572 | 2031/11/15 |
| | SOUTHWESTERN ENERGY | 5.375 | 300 | 312 | 35,519 | 2029/2/1 |
| | SOUTHWESTERN ENERGY CO | 5.375 | 200 | 211 | 24,050 | 2030/3/15 |
| | SPCM SA | 3.375 | 200 | 192 | 21,831 | 2030/3/15 |
| | SPECIALTY BUILDING PRODU | 6.375 | 125 | 130 | 14,876 | 2026/9/30 |
| | SPIRIT AEROSYSTEMS INC | 7.5 | 225 | 237 | 26,955 | 2025/4/15 |
| | SPIRIT AEROSYSTEMS INC | 4.6 | 50 | 49 | 5,587 | 2028/6/15 |
| | SPIRIT LOYALTY KY LTD/IP | 8.0 | 125 | 137 | 15,603 | 2025/9/20 |
| | SPRINGLEAF FINANCE CORP | 6.875 | 25 | 27 | 3,165 | 2025/3/15 |
| | SPRINGLEAF FINANCE CORP | 7.125 | 150 | 170 | 19,404 | 2026/3/15 |
| SPRINGLEAF FINANCE CORP | 6.625 | 225 | 252 | 28,662 | 2028/1/15 | |
| SPRINT CAPITAL CORP | 8.75 | 400 | 600 | 68,168 | 2032/3/15 | |
| SRM ESCROW ISSUER LLC | 6.0 | 225 | 237 | 26,925 | 2028/11/1 | |
| SRS DISTRIBUTION INC | 6.0 | 175 | 176 | 20,022 | 2029/12/1 | |
| SS&C TECHNOLOGIES INC | 5.5 | 175 | 182 | 20,780 | 2027/9/30 | |
| STANDARD INDUSTRIES INC | 5.0 | 75 | 77 | 8,792 | 2027/2/15 | |
| STANDARD INDUSTRIES INC | 4.75 | 50 | 51 | 5,820 | 2028/1/15 | |
| STANDARD INDUSTRIES INC | 4.375 | 150 | 150 | 17,081 | 2030/7/15 | |
| STANDARD INDUSTRIES INC | 3.375 | 150 | 141 | 16,038 | 2031/1/15 | |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|-------|------|-------|--------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | STAPLES INC | 7.5 | 75 | 75 | 8,532 | 2026/4/15 |
| | STAPLES INC | 10.75 | 350 | 325 | 36,942 | 2027/4/15 |
| | STATION CASINOS LLC | 4.625 | 50 | 49 | 5,658 | 2031/12/1 |
| | STL HOLDING CO LLC | 7.5 | 325 | 341 | 38,755 | 2026/2/15 |
| | STUDIO CITY FINANCE LTD | 5.0 | 200 | 179 | 20,378 | 2029/1/15 |
| | SUMMIT MID HLDS LLC / FI | 5.75 | 75 | 67 | 7,637 | 2025/4/15 |
| | SUNNOVA ENERGY CORP | 5.875 | 257 | 263 | 29,922 | 2026/9/1 |
| | SUNOCO LP/FINANCE CORP | 6.0 | 175 | 183 | 20,843 | 2027/4/15 |
| | SUNOCO LP/FINANCE CORP | 4.5 | 75 | 75 | 8,527 | 2029/5/15 |
| | SUNOCO LP/FINANCE CORP | 4.5 | 125 | 126 | 14,317 | 2030/4/30 |
| | SWF ESCROW ISSUER CORP | 6.5 | 225 | 216 | 24,588 | 2029/10/1 |
| | SWITCH LTD | 3.75 | 425 | 429 | 48,825 | 2028/9/15 |
| | SWITCH LTD | 4.125 | 50 | 51 | 5,845 | 2029/6/15 |
| | SYNEOS HEALTH INC | 3.625 | 275 | 272 | 30,910 | 2029/1/15 |
| | T-MOBILE USA INC | 3.375 | 100 | 102 | 11,605 | 2029/4/15 |
| | T-MOBILE USA INC | 3.5 | 125 | 130 | 14,808 | 2031/4/15 |
| | T-MOBILE USA INC | 3.5 | 100 | 104 | 11,846 | 2031/4/15 |
| | TALEN ENERGY SUPPLY LLC | 10.5 | 75 | 41 | 4,706 | 2026/1/15 |
| | TALEN ENERGY SUPPLY LLC | 7.25 | 250 | 226 | 25,768 | 2027/5/15 |
| | TALEN ENERGY SUPPLY LLC | 6.625 | 75 | 67 | 7,637 | 2028/1/15 |
| | TALEN ENERGY SUPPLY LLC | 7.625 | 25 | 22 | 2,566 | 2028/6/1 |
| | TALOS PRODUCTION INC | 12.0 | 150 | 158 | 18,044 | 2026/1/15 |
| | TAP ROCK RESOURCES LLC | 7.0 | 150 | 152 | 17,301 | 2026/10/1 |
| | TARGA RESOURCES PARTNERS | 5.0 | 175 | 181 | 20,665 | 2028/1/15 |
| | TARGA RESOURCES PARTNERS | 5.5 | 100 | 109 | 12,457 | 2030/3/1 |
| | TARGA RESOURCES PARTNERS | 4.875 | 150 | 163 | 18,535 | 2031/2/1 |
| | TARGA RESOURCES PARTNERS | 4.0 | 150 | 156 | 17,808 | 2032/1/15 |
| | TAYLOR MORRISON | 6.625 | 75 | 79 | 8,988 | 2027/7/15 |
| | TAYLOR MORRISON COMM | 5.75 | 100 | 112 | 12,776 | 2028/1/15 |
| | TAYLOR MORRISON COMM | 5.125 | 75 | 81 | 9,223 | 2030/8/1 |
| | TEGNA INC | 4.625 | 150 | 152 | 17,275 | 2028/3/15 |
| | TEINE ENERGY LTD | 6.875 | 125 | 128 | 14,539 | 2029/4/15 |
| | TELECOM ITALIA CAPITAL | 6.0 | 125 | 128 | 14,582 | 2034/9/30 |
| | TELESAT CANADA/TELESAT L | 5.625 | 75 | 70 | 8,009 | 2026/12/6 |
| | TELESAT CANADA/TELESAT L | 4.875 | 75 | 66 | 7,570 | 2027/6/1 |
| | TELESAT CANADA/TELESAT L | 6.5 | 250 | 199 | 22,620 | 2027/10/15 |
| | TENET HEALTHCARE CORP | 6.75 | 200 | 214 | 24,358 | 2023/6/15 |
| | TENET HEALTHCARE CORP | 5.125 | 200 | 208 | 23,699 | 2027/11/1 |
| | TENET HEALTHCARE CORP | 4.625 | 75 | 77 | 8,783 | 2028/6/15 |
| | TENET HEALTHCARE CORP | 6.125 | 300 | 315 | 35,863 | 2028/10/1 |
| | TENET HEALTHCARE CORP | 4.25 | 175 | 177 | 20,126 | 2029/6/1 |
| | TENNECO INC | 5.0 | 25 | 24 | 2,734 | 2026/7/15 |
| | TENNECO INC | 7.875 | 125 | 135 | 15,402 | 2029/1/15 |
| | TENNECO INC | 5.125 | 100 | 97 | 11,045 | 2029/4/15 |
| | TEREX CORP | 5.0 | 150 | 153 | 17,447 | 2029/5/15 |
| | TERRAFORM POWER OPERATIN | 4.75 | 125 | 128 | 14,580 | 2030/1/15 |
| | THOR INDUSTRIES | 4.0 | 50 | 49 | 5,657 | 2029/10/15 |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|-------|------|-------|--------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | TITAN ACQ/CO-BORROWER | 7.75 | 100 | 101 | 11,555 | 2026/4/15 |
| | TKC HOLDINGS INC | 10.5 | 75 | 80 | 9,102 | 2029/5/15 |
| | TMS INTERNATIONAL CORP | 6.25 | 150 | 150 | 17,143 | 2029/4/15 |
| | TOPS HOLDING II ESCROW | — | 307 | — | — | 2022/6/15 |
| | TPC GROUP INC | 10.5 | 150 | 111 | 12,632 | 2024/8/1 |
| | TRANSDIGM INC | 7.5 | 200 | 209 | 23,847 | 2027/3/15 |
| | TRANSDIGM INC | 5.5 | 450 | 459 | 52,179 | 2027/11/15 |
| | TRANSDIGM INC | 4.625 | 100 | 98 | 11,196 | 2029/1/15 |
| | TRANSDIGM INC | 4.875 | 150 | 147 | 16,712 | 2029/5/1 |
| | TRANSOCEAN GUARDIAN LTD | 5.875 | 16 | 15 | 1,795 | 2024/1/15 |
| | TRANSOCEAN INC | 11.5 | 140 | 136 | 15,502 | 2027/1/30 |
| | TRANSOCEAN INC | 8.0 | 100 | 70 | 7,968 | 2027/2/1 |
| | TRANSOCEAN POSEIDON | 6.875 | 50 | 48 | 5,545 | 2027/2/1 |
| | TRANSOCEAN SENTRY LTD | 5.375 | 62 | 60 | 6,911 | 2023/5/15 |
| | TRAVEL + LEISURE CO | 4.5 | 100 | 99 | 11,300 | 2029/12/1 |
| | TRI POINTE GROUP INC | 5.7 | 75 | 82 | 9,351 | 2028/6/15 |
| | TRIDENT TPI HOLDINGS INC | 9.25 | 225 | 233 | 26,556 | 2024/8/1 |
| | TRIUMPH GROUP INC | 6.25 | 50 | 50 | 5,735 | 2024/9/15 |
| | TRIUMPH GROUP INC | 7.75 | 100 | 99 | 11,313 | 2025/8/15 |
| | TRONOX INC | 4.625 | 175 | 173 | 19,703 | 2029/3/15 |
| | UBER TECHNOLOGIES INC | 8.0 | 25 | 26 | 3,028 | 2026/11/1 |
| | UBER TECHNOLOGIES INC | 7.5 | 225 | 244 | 27,777 | 2027/9/15 |
| | UBER TECHNOLOGIES INC | 6.25 | 100 | 107 | 12,215 | 2028/1/15 |
| | UBER TECHNOLOGIES INC | 4.5 | 125 | 125 | 14,299 | 2029/8/15 |
| | UNIFRAX ESCROW ISS CORP | 5.25 | 25 | 25 | 2,863 | 2028/9/30 |
| | UNIFRAX ESCROW ISS CORP | 7.5 | 25 | 24 | 2,836 | 2029/9/30 |
| | UNITED AIRLINES HOLDINGS | 5.0 | 25 | 25 | 2,921 | 2024/2/1 |
| | UNITED AIRLINES HOLDINGS | 4.875 | 125 | 128 | 14,606 | 2025/1/15 |
| | UNITED AIRLINES INC | 4.375 | 100 | 102 | 11,680 | 2026/4/15 |
| | UNITED AIRLINES INC | 4.625 | 100 | 103 | 11,762 | 2029/4/15 |
| | UNITED WHOLESALE MTGE LL | 5.75 | 50 | 49 | 5,657 | 2027/6/15 |
| | UNITED WHOLESALE MTGE LL | 5.5 | 325 | 314 | 35,696 | 2029/4/15 |
| | UNIVISION COMMUNICATIONS | 5.125 | 175 | 178 | 20,228 | 2025/2/15 |
| | UNIVISION COMMUNICATIONS | 9.5 | 75 | 80 | 9,158 | 2025/5/1 |
| | UNIVISION COMMUNICATIONS | 4.5 | 100 | 102 | 11,637 | 2029/5/1 |
| | UPC BROADBAND FINCO BV | 4.875 | 200 | 206 | 23,421 | 2031/7/15 |
| | USA COM PART/USA COM FIN | 6.875 | 225 | 234 | 26,620 | 2026/4/1 |
| | USA COM PART/USA COM FIN | 6.875 | 125 | 129 | 14,724 | 2027/9/1 |
| | VALEANT PHARMACEUTICALS | 9.0 | 150 | 157 | 17,901 | 2025/12/15 |
| | VENTURE GLOBAL CALCASIEU | 3.875 | 125 | 129 | 14,739 | 2029/8/15 |
| | VENTURE GLOBAL CALCASIEU | 4.125 | 100 | 105 | 11,942 | 2031/8/15 |
| | VENTURE GLOBAL CALCASIEU | 3.875 | 125 | 129 | 14,686 | 2033/11/1 |
| | VERSCEND HOLDING CORP | 9.75 | 150 | 158 | 18,026 | 2026/8/15 |
| | VICI PROPERTIES / NOTE | 4.25 | 75 | 78 | 8,888 | 2026/12/1 |
| | VICI PROPERTIES / NOTE | 4.625 | 50 | 53 | 6,076 | 2029/12/1 |
| | VICI PROPERTIES / NOTE | 4.125 | 50 | 50 | 6,026 | 2030/8/15 |
| | VICTORS MERGER CORP | 6.375 | 75 | 70 | 7,961 | 2029/5/15 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|--------|------|-------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| | VIKING CRUISES LTD | 13.0 | 175 | 198 | 22,525 | 2025/5/15 |
| | VIKING CRUISES LTD | 5.875 | 150 | 143 | 16,247 | 2027/9/15 |
| | VIKING CRUISES LTD | 7.0 | 100 | 99 | 11,291 | 2029/2/15 |
| | VIKING OCEAN CRUISES SHI | 5.625 | 50 | 49 | 5,569 | 2029/2/15 |
| | VIPER ENERGY PARTNERS LP | 5.375 | 225 | 233 | 26,519 | 2027/11/1 |
| | VIRGIN AUSTRALIA HOLDING | — | 50 | 3 | 362 | 2024/11/15 |
| | VISTRA OPERATIONS CO LLC | 5.0 | 375 | 384 | 43,696 | 2027/7/31 |
| | VMED O2 UK FINANCING I | 4.25 | 200 | 196 | 22,319 | 2031/1/31 |
| | VODAFONE GROUP PLC | 7.0 | 180 | 215 | 24,490 | 2079/4/4 |
| | WASH MULTIFAM ACQ INC | 5.75 | 275 | 285 | 32,478 | 2026/4/15 |
| | WEATHERFORD INTERNATIONA | 8.625 | 150 | 149 | 17,027 | 2030/4/30 |
| | WEEKLEY HOMES LLC/ FINAN | 4.875 | 225 | 230 | 26,170 | 2028/9/15 |
| | WERNER FINCO LP/INC | 8.75 | 300 | 313 | 35,558 | 2025/7/15 |
| | WESTERN GLOBAL AIRLINES | 10.375 | 100 | 111 | 12,631 | 2025/8/15 |
| | WESTERN MIDSTREAM OPERAT | 4.35 | 175 | 181 | 20,570 | 2025/2/1 |
| | WESTERN MIDSTREAM OPERAT | 5.3 | 100 | 109 | 12,399 | 2030/2/1 |
| | WESTERN MIDSTREAM OPERAT | 5.3 | 150 | 176 | 19,998 | 2048/3/1 |
| | WHEEL PROS INC | 6.5 | 250 | 243 | 27,621 | 2029/5/15 |
| | WHITE CAP BUYER LLC | 6.875 | 175 | 183 | 20,798 | 2028/10/15 |
| | WHITE CAP PARENT LLC | 8.25 | 150 | 153 | 17,402 | 2026/3/15 |
| | WR GRACE HOLDING LLC | 5.625 | 250 | 253 | 28,818 | 2029/8/15 |
| | WYNDHAM DESTINATIONS INC | 6.625 | 150 | 164 | 18,720 | 2026/7/31 |
| | WYNN LAS VEGAS LLC/CORP | 5.5 | 50 | 50 | 5,769 | 2025/3/1 |
| | WYNN LAS VEGAS LLC/CORP | 5.25 | 200 | 199 | 22,625 | 2027/5/15 |
| | ZIGGO BV | 4.875 | 200 | 206 | 23,505 | 2030/1/15 |
| 合 | 計 | | | | 11,869,587 | |

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* 評価額が「—」となっている銘柄は、評価を計上しておりません。

外国その他有価証券

(A) 外国貸付債権

| 区 分 | 当 期 末 | | |
|----------------|-------------|---------------|----------|
| | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比 率 |
| (アメリカ) 貸付債権 | 千米ドル 888 | 千円 100,862 | % 0.8 |
| 合 計 | 888 | 100,862 | 0.8 |

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 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。

(B) 外国貸付債権 銘柄別

| 銘柄 | 債権 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|---------|-------|-------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 貸付債権 | | | | | |
| | PARKER DRILLING 2ND | 11.0 | 18 | 17 | 1,979 | 2024/3/26 |
| | SPECTACLE GARY HLDNGS TL | 11.0 | 162 | 177 | 20,118 | 2024/10/17 |
| | SPECTACLE GARY DD TRM | 11.0 | 11 | 12 | 1,457 | 2025/12/23 |
| | ASCENT RESOURCES TL | 10.0 | 115 | 124 | 14,113 | 2025/11/1 |
| | STAPLES 2019 RFNIG B1 TL | 5.13163 | 146 | 140 | 15,905 | 2026/4/9 |
| | DIAMOND SPORTS B TRM | 3.35 | 73 | 33 | 3,860 | 2026/8/24 |
| | CLEAR CHANNEL OUTD B#1 | 3.62863 | 73 | 71 | 8,153 | 2026/8/9 |
| | CLEAR CHANNEL OUTD B#8 | 3.60075 | 0.187 | 0.183 | 20 | 2026/8/9 |
| | AMERICAN AIRLINS IniL TL | 5.5 | 300 | 310 | 35,252 | 2028/3/10 |
| 合 | 計 | | | | 100,862 | |

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* 決算日時点で受け渡し完了していない新規買付ローンに関しましては、クーポンレートが確定しておりません。

○投資信託財産の構成

(2021年12月8日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 93,416 | 0.7 |
| 新株予約権証券 | 6,453 | 0.1 |
| 公社債 | 11,869,587 | 93.2 |
| 貸付債権 | 100,862 | 0.8 |
| コール・ローン等、その他 | 670,479 | 5.2 |
| 投資信託財産総額 | 12,740,797 | 100.0 |

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 当期末における外貨建純資産（12,586,788千円）の投資信託財産総額（12,740,797千円）に対する比率は98.8%です。

* 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=113.57円。

○特定資産の価格等の調査

調査依頼を行なった取引は2020年11月17日から2021年12月6日までの間で金銭債権（貸付債権）19件でした。これらの金銭債権（貸付債権）について、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）第11条第2項に基づいて比較可能な価格のほか、金銭債権の債務者、額面、担保の設定状況、約定価格その他の当該金銭債権（貸付債権）の内容に関して、EY新日本有限責任監査法人に調査を委託し、日本公認会計士協会が公表した専門業務実務指針4460「投資信託及び投資法人における特定資産の価格等の調査に係る合意された手続業務に関する実務指針」に基づく調査結果として合意された手続実施結果報告書を入手しています。

なお、本調査は財務諸表監査の一部ではなく、また、価格の妥当性や内部管理体制について保証を提供するものではありません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年12月8日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 12,808,898,271 |
| コール・ローン等 | 435,631,948 |
| 株式(評価額) | 93,416,218 |
| 新株予約権証券(評価額) | 6,453,079 |
| 公社債(評価額) | 11,869,587,124 |
| 貸付債権 | 100,862,591 |
| 未収入金 | 131,847,503 |
| 未収配当金 | 1,390 |
| 未収利息 | 167,001,957 |
| 前払費用 | 4,096,461 |
| (B) 負債 | 166,745,518 |
| 未払金 | 103,045,470 |
| 未払解約金 | 63,700,000 |
| 未払利息 | 48 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 12,642,152,753 |
| 元本 | 4,194,241,335 |
| 次期繰越損益金 | 8,447,911,418 |
| (D) 受益権総口数 | 4,194,241,335口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 30,142円 |

(注) 期首元本額は4,937,939,077円、期中追加設定元本額は33,584,554円、期中一部解約元本額は777,282,296円、1口当たり純資産額は3,0142円です。

(注) 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

- ・野村米国好利回り社債投信 Dコース 2,479,111,946円
- ・ノムラ・グローバル・オールスターズ 741,226,143円
- ・野村米国好利回り社債投信 Bコース 406,343,461円
- ・野村米国好利回り社債投信 Cコース 383,071,693円
- ・野村米国好利回り社債投信 Aコース 184,488,092円

○損益の状況 (2020年12月9日～2021年12月8日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 759,052,556 |
| 受取配当金 | 962,941 |
| 受取利息 | 749,217,555 |
| その他収益金 | 8,901,823 |
| 支払利息 | △ 29,763 |
| (B) 有価証券売買損益 | 1,313,592,742 |
| 売買益 | 1,613,734,273 |
| 売買損 | △ 300,141,531 |
| (C) 保管費用等 | △ 11,142,262 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 2,061,503,036 |
| (E) 前期繰越損益金 | 7,720,593,406 |
| (F) 追加信託差損益金 | 60,515,446 |
| (G) 解約差損益金 | △1,394,700,470 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 8,447,911,418 |
| 次期繰越損益金(H) | 8,447,911,418 |

*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。

「当ファンドの運用の一部を委託されている米国の投資顧問会社(米国投資顧問会社)は、米国の証券関連法令(「米国法」)の適用を受けています。当該米国投資顧問会社は、米国法を遵守するという限定的な目的で、Arthur F. Bell, Jr. & Associates, L. L. C. (「アーサー・ベル社」)を、当ファンドの受益者の「独立した代理人」に任命しました。アーサー・ベル社はCohen & Company (「コーヘン社」)と合併したため、コーヘン社が当ファンドの独立した代理人として従事します。コーヘン社は、「独立した代理人」として、米国法で定められている口座明細書やその他の必要な通知を、当ファンドの受益者に代わって当ファンドの受託銀行または保管銀行から受け取ります。コーヘン社が「独立した代理人」としての地位を失うのは、(1)同社が辞任したとき、(2)同社の退任を当ファンドの受益者が承諾したとき、または(3)同社の解任が受益者にとって最善の利益になると独立の第三者が判断したときのみです。コーヘン社が「独立した代理人」に任命されることによって、受益者のみなさまが現在受け取っている当ファンドに関する運用報告書の内容、お知らせ、その他の情報に何ら影響が及ぶものではありません。」

○お知らせ

該当事項はございません。