

野村米国ハイ・イールド・ファンド (年1回決算型) 為替ヘッジあり

運用報告書(全体版)

第2期(決算日2015年6月12日)

作成対象期間(2014年6月13日～2015年6月12日)

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券	
信託期間	2013年11月15日以降、無期限とします。	
運用方針	中長期的に、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積極的な運用を行うことを基本とします。高利回り社債オープン マザーファンド(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)に実質的な投資を行います。ハイ・イールド・ボンドへの投資にあたっては、投資対象の徹底したクレジット分析を行うことにより、信用リスクのコントロールを行います。ポートフォリオによる分散投資によりリスクの低減を図ることを基本とします。実質組入外貨建て資産については、原則として為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図ることを目指します。	
主な投資対象	野村米国ハイ・イールド・ファンド(年1回決算型) 為替ヘッジあり	マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、債券に直接投資する場合があります。
	マザーファンド	米国ドル建ての高利回り事業債(ハイ・イールド・ボンド)を主要投資対象とします。なお、米国ドル建て以外のハイ・イールド・ボンドに投資する場合があります。
主な投資制限	野村米国ハイ・イールド・ファンド(年1回決算型) 為替ヘッジあり	外貨建て資産への実質投資割合には制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。株式への投資は、優先証券のうち株券等の性質を有するものまたは転換社債を転換したもの等に限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の30%以内とします。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益等から、利子・配当等収益等の水準及び基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



サポートダイヤル 0120-753104

(受付時間) 営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			参考指数		債組入比率	債先物比率	純資産額
	(分配落)	税込 分配	み 騰落	期 騰落	中 騰落			
(設定日)	円	円	%		%	%	%	百万円
2013年11月15日	10,000	—	—	100.00	—	—	—	1
1期(2014年6月12日)	10,601	0	6.0	106.32	6.3	94.9	—	581
2期(2015年6月12日)	10,361	0	△2.3	106.35	0.0	97.6	—	334

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

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*参考指数(=BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・コンストレインド・インデックス(円ヘッジベース))は、BofA Merrill Lynch US High Yield, Cash Pay, 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。

*参考指数は設定時を100として指数化しています。

(出所)ブルームバーグ、(出所および許可)バンクオブアメリカ・メリルリンチ

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考指数		債組入比率	債先物比率
	騰落	騰落率	騰落	騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
2014年6月12日	10,601	—	106.32	—	94.9	—
6月末	10,648	0.4	106.71	0.4	93.8	—
7月末	10,548	△0.5	105.90	△0.4	96.3	—
8月末	10,608	0.1	106.80	0.4	97.7	—
9月末	10,333	△2.5	104.18	△2.0	96.1	—
10月末	10,400	△1.9	105.64	△0.6	95.1	—
11月末	10,335	△2.5	105.18	△1.1	98.6	—
12月末	10,104	△4.7	103.37	△2.8	96.9	—
2015年1月末	10,125	△4.5	104.02	△2.2	94.6	—
2月末	10,332	△2.5	106.37	0.0	95.1	—
3月末	10,302	△2.8	105.83	△0.5	124.0	—
4月末	10,413	△1.8	107.01	0.6	93.8	—
5月末	10,433	△1.6	107.25	0.9	97.3	—
(期末)						
2015年6月12日	10,361	△2.3	106.35	0.0	97.6	—

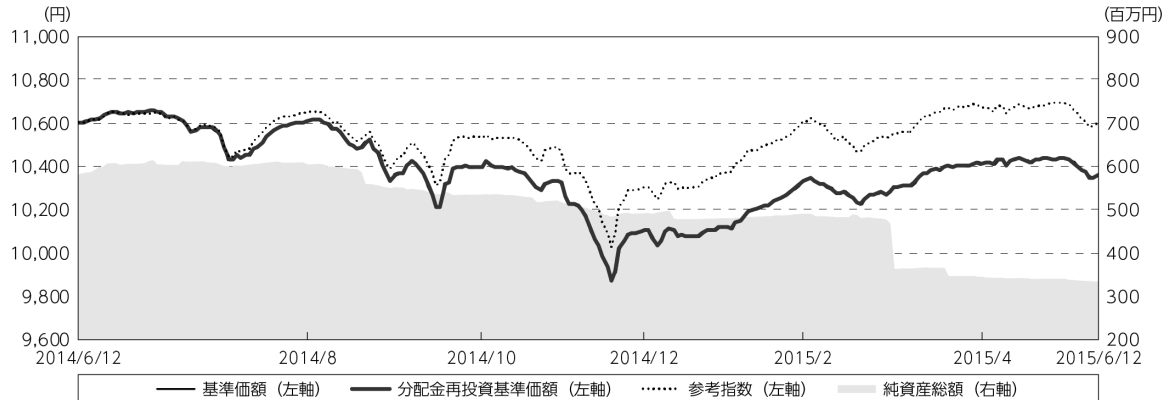
*騰落率は期首比です。

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

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(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(2014年6月12日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 参考指数は、BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ベイ・CONSTREIND・インデックス(円ヘッジベース)です。作成期首(2014年6月12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10,601円から当作成期末には10,361円となりました。

- ・ハイ・イールド債券からの高い利息収入
- ・好調な米国企業決算や、一部の米国経済指標が市場予想を上回ったことを背景としたハイ・イールド債券の価格上昇
- ・原油価格の下落を背景としたハイ・イールド債券の価格下落

○投資環境

米国ハイ・イールド債券市場は、当作成期間では上昇しました（トータルリターン・現地通貨ベース）。米国の主要経済指標や米国の企業決算、FRB（米連邦準備制度理事会）の動向や原油価格の動向などに左右されました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村米国ハイ・イールド・ファンド(年1回決算型)為替ヘッジあり]

主要投資対象である〔高利回り社債オープン マザーファンド〕の組み入れを高位に維持しました。実質組入外貨建て資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。

[高利回り社債オープン マザーファンド]

・資産別組入比率

ハイ・イールド債券の組み入れについては、当作成期間を通じて高位を維持しました。

・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、BBB格以上、BB格、B格、CCC格、CC格、C格以下及び無格付けの組入比率は、当作成期末には1.1%、15.4%、37.4%、40.6%、0.5%、2.0%としました。

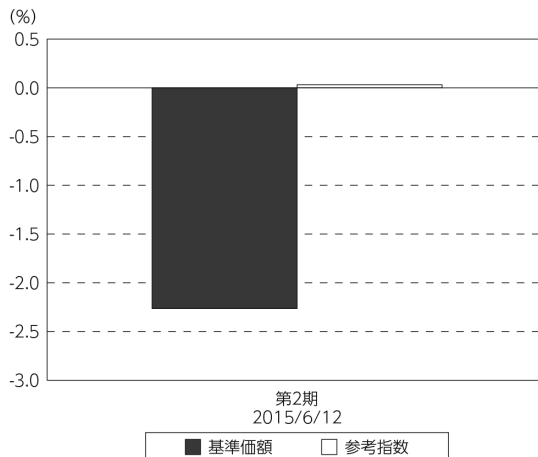
○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

当作成期間に、参考指数の騰落率が0.0%となったのに対し、基準価額の騰落率は-2.3%となりました。主な差異の要因は、[高利回り社債オープン マザーファンド]において、相対的にパフォーマンスが悪かったCCC格以下の銘柄の保有比率を参考指数よりも高めにしていたことなどです。

基準価額と参考指数の対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 参考指数は、BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ペイ・コンストレインド・インデックス（円ヘッジベース）です。

◎分配金

当作成期の収益分配金は、利子・配当等収益の水準および基準価額等を勘案し、分配は行いませんでした。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す。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第2期
	2014年6月13日～ 2015年6月12日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	758

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

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

◎今後の運用方針

[高利回り社債オープン マザーファンド]

- ・当ファンドは、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ってまいります。また、銘柄選択では多くの発行体に投資を行う分散投資を基本とし、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、高水準のインカムゲイン（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、米国経済の拡大、企業利益の増加を背景に当面は堅調に推移すると考えられます。デフォルト（債務不履行）率は、エネルギーセクターでの上昇が予想されますが、米国ハイ・イールド債市場全体では、好調な米国景気を背景に今後も低水準で推移すると考えられます。FRB（米連邦準備制度理事会）による金融政策は様々な経済データを考慮すると表明しており、金利上昇は緩やかなペースになると予想されます。その為、金利の急上昇に伴う米国ハイ・イールド債券の価格下落が起こる可能性は低いと考えます。格付け別では新規発行や割安感のあるB格、CCC格の銘柄を組み入れ、デュレーション（金利感応度）の短い銘柄や良質な銘柄を選好する方針です。業種別ではエネルギーセクターの中でも財務状況や投資計画が健全な企業には投資機会があると判断しています。
- ・個別銘柄の選択に際しては、より一層慎重な対応を行ってまいります。今後も引き続きキャッシュフロー（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う方針です。

[野村米国ハイ・イールド・ファンド(年1回決算型)為替ヘッジあり]

主要投資対象である [高利回り社債オープン マザーファンド] の組み入れを高位に維持します。なお、実質組入外貨建て資産については、為替変動リスクを低減するため、原則として為替ヘッジを行います。

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。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2014年6月13日～2015年6月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 191	% 1.836	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(107)	(1.026)	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)	(78)	(0.756)	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)	(6)	(0.054)	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) 有 価 証 券 取 引 税	0	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
(株 式)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	9	0.086	(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)	(6)	(0.053)	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)	(0.002)	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)	(3)	(0.031)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	200	1.922	
期中の平均基準価額は、10,381円です。			

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

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 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）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2014年6月13日～2015年6月12日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
高利回り社債オープン マザーファンド	千口 34,493	千円 82,310	千口 162,182	千円 414,580

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2014年6月13日～2015年6月12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
	高利回り社債オープン マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	556,131千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,139,940千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.48

*(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

(2014年6月13日～2015年6月12日)

利害関係人との取引状況

<野村米国ハイ・イールド・ファンド(年1回決算型)為替ヘッジあり>

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	$\frac{D}{C}$

<高利回り社債オープン マザーファンド>

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$

平均保有割合 0.4%

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

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

○組入資産の明細

(2015年6月12日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
高利回り社債オープン マザーファンド	千口 249,983	千口 122,294	千円 338,743

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2015年6月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
高利回り社債オープン マザーファンド	千円 338,743	% 97.7
コール・ローン等、その他	8,099	2.3
投資信託財産総額	346,842	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*高利回り社債オープン マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産(117,193,825千円)の投資信託財産総額(118,757,789千円)に対する比率は98.7%です。

*外貨建て資産は、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=123.46円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年6月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	671,676,439
コール・ローン等	3,378,134
高利回り社債オープン マザーファンド(評価額)	338,743,892
未収入金	329,554,407
未収利息	6
(B) 負債	337,302,825
未払金	332,549,775
未払解約金	812,004
未払信託報酬	3,936,473
その他未払費用	4,573
(C) 純資産総額(A-B)	334,373,614
元本	322,732,131
次期繰越損益金	11,641,483
(D) 受益権総口数	322,732,131口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,361円

(注) 期首元本額548百万円、期中追加設定元本額98百万円、期中一部解約元本額324百万円、計算口数当たり純資産額10,361円。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額802,487,855円。(14年1月7日～15年1月5日、高利回り社債オープン マザーファンド)

○損益の状況 (2014年6月13日～2015年6月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	16,585
受取利息	3,518
その他収益金	13,067
(B) 有価証券売買損益	2,232,591
売買益	98,730,201
売買損	△96,497,610
(C) 信託報酬等	△ 9,229,280
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 6,980,104
(E) 前期繰越損益金	5,322,131
(F) 追加信託差損益金	13,299,456
(配当等相当額)	(1,941,458)
(売買損益相当額)	(11,357,998)
(G) 計(D+E+F)	11,641,483
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	11,641,483
追加信託差損益金	13,299,456
(配当等相当額)	(2,245,236)
(売買損益相当額)	(11,054,220)
分配準備積立金	22,223,248
繰越損益金	△23,881,221

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

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

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

(注) 分配金の計算過程(2014年6月13日～2015年6月12日)は以下の通りです。

項 目	第2期
	2014年6月13日～ 2015年6月12日
a. 配当等収益(経費控除後)	16,901,117円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	2,245,236円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	5,322,131円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	24,468,484円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	758円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○分配金のお知らせ

1 万円当たり分配金 (税込み)	0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

- ①運用報告書（全体版）について電磁的方法により提供する所要の約款変更を行いました。
 <変更適用日：2014年12月1日>
- ②書面決議の要件緩和等に関する所要の約款変更を行いました。
 <変更適用日：2014年12月1日>
- ③書面決議に反対した受益者が受託者に対して行う受益権の買取請求を不適用とする所要の約款変更を行いました。
 <変更適用日：2014年12月1日>
- ④デリバティブ取引等に係る投資制限に関する所要の約款変更を行いました。
 <変更適用日：2015年2月25日>

○ (参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

(2015年6月12日現在)

<高利回り社債オープン マザーファンド>

下記は、高利回り社債オープン マザーファンド全体(42,252,437千口)の内容です。

外国株式

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			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		
ALLY FINANCIAL 8.50% Series A	356	148	390	48,251	消費者金融	
ALLY FINANCIAL 7.0000% SERIES 144A	73	23	2,402	296,581	消費者金融	
CATALYST PAPER CORP	168	168	51	6,346	紙製品・林産品	
CITIGROUP INC 6.8750% Series K	457	457	1,221	150,832	銀行	
COWEN GROUP INC 8.2500% 10/15/21 SERIES	—	317	851	105,161	資本市場	
DIRECTBUY HOLDINGS INC	48	48	—	—	専門小売り	
EME REORGANIZATION TRUST	45,383	45,383	40	5,042	電力	
GMAC CAP TR I 8.125% 2/15/40 Series2	270	270	703	86,829	各種金融サービス	
GEN FIN CORP 8.1250% 7/31/21 Series	—	283	743	91,802	商社・流通業	
REGIONS FINL (RF) 6.3750% Series A	160	160	400	49,498	銀行	
合計	株数・金額	46,919	47,261	6,806	840,346	
	銘柄数<比率>	8	10	—	<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、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株式評価額の比率。

* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。

* 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。

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区分	額面金額	当 期		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		評価額				5年以上	2年以上	2年未満
		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	949,799	913,219	112,746,130	96.3	95.2	63.4	30.6	2.4
合計	949,799	913,219	112,746,130	96.3	95.2	63.4	30.6	2.4

* 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、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。

* スタンダード・アンド・プアーズ、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、無格付けのものが1.0%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)					
	1839688 ALBERTA ULC	14.0	140	89	11,098	2020/2/13
	99 CENTS ONLY STORES	11.0	2,525	2,626	324,205	2019/12/15
	A SCHULMAN INC	6.875	775	790	97,595	2023/6/1
	AAF HLG/FIN	6.0	1,367	1,298	160,358	2019/7/1
	ACCURIDE CORP	9.5	3,125	3,218	397,386	2018/8/1
	ACE CASH EXPRESS INC	11.0	1,165	678	83,781	2019/2/1
	ACTIVISION BLIZZARD	5.625	300	319	39,399	2021/9/15
	ADVANCED MICRO DEVICES	6.75	1,650	1,472	181,810	2019/3/1
	ADVANCED MICRO DEVICES	7.0	1,700	1,428	176,300	2024/7/1
	AES CORPORATION	5.5	1,350	1,329	164,170	2024/3/15
	AFFINIA GROUP INC	7.75	2,225	2,330	287,746	2021/5/1
	AFFINION GROUP HOLDINGS	13.75	1,815	953	117,668	2018/9/15
	AFFINION INVESTMENTS LLC	13.5	841	458	56,620	2018/8/15
	AFFINITY GAMING/FIN	9.0	450	447	55,279	2018/5/15
	AGUILA 3 SA	7.875	400	401	49,585	2018/1/31
	AIR CANADA	8.75	1,175	1,293	159,753	2020/4/1
	AIR CANADA	7.75	3,625	3,887	479,989	2021/4/15
	AIR CANADA 2013-1B PTC	5.375	176	184	22,775	2022/11/15
	AIRCASTLE LTD	6.25	950	1,045	129,015	2019/12/1
	AK STEEL CORP	8.375	2,700	2,308	285,007	2022/4/1
	ALBEA BEAUTY HOLDINGS SA	8.375	875	938	115,859	2019/11/1
	ALCATEL-LUCENT USA INC	6.75	1,600	1,682	207,659	2020/11/15
	ALERE INC	6.5	1,700	1,776	219,326	2020/6/15
	ALERIS INTL INC	7.625	625	648	80,056	2018/2/15
	ALERIS INTL INC	7.875	725	752	92,865	2020/11/1
	ALGECO SCOTSMAN GLOB FIN	10.75	1,950	1,540	190,190	2019/10/15
	ALLEN SYSTEMS GROUP INC	—	2,700	668	82,502	2016/11/15
	ALLIANT TECHSYSTEMS INC	5.25	250	257	31,790	2021/10/1
	ALLY FINANCIAL	8.0	1,506	1,769	218,468	2020/3/15
	ALLY FINANCIAL INC	7.5	958	1,116	137,790	2020/9/15
	ALLY FINANCIAL INC	5.125	47	47	5,875	2024/9/30
	ALPHA NATURAL RESOURCES	9.75	325	48	6,018	2018/4/15
	ALPHA NATURAL RESOURCES	6.0	1,000	115	14,197	2019/6/1
	ALPHA NATURAL RESOURCES	7.5	450	98	12,153	2020/8/1
	ALTA MESA HLDGS/FINANC S	9.625	1,575	1,287	158,962	2018/10/15
	ALTICE FINANCING SA	7.875	325	344	42,582	2019/12/15
	ALTICE FINCO SA	9.875	325	359	44,337	2020/12/15
	ALTICE SA	7.75	2,400	2,400	296,304	2022/5/15
	ALTICE US FINANCING SA	7.75	1,000	975	120,373	2025/7/15
	AMC ENTERTAINMENT INC	5.875	325	337	41,629	2022/2/15
	AMC NETWORKS INC	7.75	3,500	3,801	469,379	2021/7/15
	AMERICAN ACHIEVEMENT COR	10.875	4,575	4,449	549,296	2016/4/15
	AMERICAN AXLE & MFG INC	6.25	3,125	3,316	409,443	2021/3/15
	AMERICAN CAPITAL LTD	6.5	1,475	1,535	189,615	2018/9/15
	AMERICAN GREETINGS	7.375	800	847	104,570	2021/12/1

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)	AMKOR TECHNOLOGIES INC	6.625	725	745	92,081	2021/6/1
	ANCESTRY.COM INC	9.625	4,300	4,445	548,795	2018/10/15
	ANCESTRY.COM INC ACOM	11.0	3,200	3,640	449,394	2020/12/15
	ANNA MERGER SUB INC	7.75	2,490	2,539	313,563	2022/10/1
	ANTERO RESOURCES CORP	6.0	850	873	107,826	2020/12/1
	ANTERO RESOURCES FINANCE	5.125	1,125	1,096	135,420	2022/12/1
	APPROACH RESOURCES INC	7.0	600	553	68,335	2021/6/15
	APPVION INC	9.0	1,225	802	99,061	2020/6/1
	APX GROUP INC	8.75	2,400	2,172	268,155	2020/12/1
	ARAMARK CORP	5.75	1,275	1,334	164,778	2020/3/15
	ARCELORMITTAL	6.25	1,425	1,503	185,606	2021/3/1
	ARCELORMITTAL	6.125	275	276	34,078	2025/6/1
	ARCELORMITTAL	7.75	775	782	96,638	2039/10/15
	ARCH COAL INC	7.0	1,150	189	23,426	2019/6/15
	ARCH COAL INC	9.875	1,800	369	45,556	2019/6/15
	ARCH COAL INC	7.25	250	71	8,796	2020/10/1
	ARCH COAL INC	7.25	425	65	8,132	2021/6/15
	ARGOS MERGER SUB INC	7.125	1,325	1,387	171,354	2023/3/15
	ARMOURED AUTOGROUP	9.25	1,912	2,000	246,973	2018/11/1
	ARTESYN ESCROW INC	9.75	2,350	2,444	301,736	2020/10/15
	ASHTREAD CAPITAL INC	6.5	2,050	2,208	272,707	2022/7/15
	ASHTON WOODS USA/FINANCE	6.875	3,975	3,716	458,854	2021/2/15
	ASSOC MAT LLC/AMH NEW FI	9.125	575	491	60,696	2017/11/1
	AUDATEX NORTH AMERICA IN	6.0	1,125	1,171	144,621	2021/6/15
	AUDATEX NORTH AMERICA IN	6.125	975	1,015	125,338	2023/11/1
	AURICO GOLD INC	7.75	1,100	1,122	138,522	2020/4/1
	AUS FINANCE PTY LTD	6.875	450	380	46,945	2019/11/1
	AV HOMES INC	8.5	1,450	1,411	174,317	2019/7/1
	AVAYA INC	10.5	3,800	3,249	401,121	2021/3/1
	B-CORP MERGER SUB INC	8.25	775	682	84,199	2019/6/1
	BANK OF AMERICA CORP	6.25	2,450	2,459	303,611	2049/9/29
	BANK OF AMERICA CORP	6.5	2,500	2,615	322,925	2049/12/31
	BANKRATE INC	6.125	950	933	115,234	2018/8/15
	BARCLAYS BANK PLC	7.625	3,650	4,204	519,113	2022/11/21
	BARCLAYS BANK PLC	7.75	3,025	3,335	411,746	2023/4/10
	BARCLAYS PLC	8.25	3,075	3,244	400,569	2049/12/29
	BEAZER HOMES USA	8.125	1,000	1,047	129,324	2016/6/15
	BEAZER HOMES USA	5.75	950	935	115,527	2019/6/15
	BEAZER HOMES USA	7.25	1,675	1,616	199,594	2023/2/1
	BEV PACK HLDS LU/ISSUER	5.625	700	702	86,746	2016/12/15
	BEV PACK HLDS LU/ISSUER	6.0	2,425	2,431	300,138	2017/6/15
	BI-LO LLC/BI-LO FIN CORP	8.625	3,125	3,015	372,309	2018/9/15
	BIOSCRIP INC	8.875	1,300	1,106	136,623	2021/2/15
	BLOCK COMMUNICATIONS INC	7.25	1,075	1,112	137,364	2020/2/1
	BLUE COAT HOLDINGS INC	8.375	1,050	1,065	131,577	2023/6/1
	BLUELINE RENTAL FINANCE	7.0	600	615	75,935	2019/2/1
	BMC SOFTWARE FINANCE INC	8.125	4,500	3,999	493,762	2021/7/15

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	
		%	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)					
	BOISE CASCADE LLC/FIN	6.375	775	821	101,422	2020/11/1
	BOMBARDIER INC	7.5	400	374	46,235	2025/3/15
	BOXER PARENT CO INC	9.0	2,400	1,941	239,635	2019/10/15
	BOYD ACQUISITION SUB/FIN	8.375	2,500	2,628	324,468	2018/2/15
	BOYD GAMING CORP	6.875	4,775	4,882	602,785	2023/5/15
	BROOKFIELD RESIDENTIAL	6.5	950	980	121,098	2020/12/15
	BROOKFIELD RESIDENTIAL	6.375	725	714	88,165	2025/5/15
	BUFFALO THUNDER DEV REGS	11.0	839	638	78,793	2022/12/9
	BUFFALO THUNDER DEV ZCPN	—	373	5	691	2099/12/15
	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	7.625	2,325	2,435	300,679	2021/6/1
	BUILDING MATERIALS HOLDI	9.0	4,625	5,018	619,537	2018/9/15
	BWAY HOLDING CO	9.125	3,850	3,994	493,145	2021/8/15
	CABLEVISION SYSTEMS CORP	8.625	2,100	2,325	287,137	2017/9/15
	CAESARS ENTERTAINMENT OP	—	2,650	2,173	268,278	2020/2/15
	CAESARS OPERATING ESCROW	—	650	531	65,603	2020/2/15
	CALFRAC HOLDINGS LP	7.5	450	419	51,806	2020/12/1
	CALIFORNIA RESOURCES CRP	6.0	3,025	2,767	341,721	2024/11/15
	CALPINE CORP	5.875	600	639	78,983	2024/1/15
	CAPSUGEL SA	7.0	1,800	1,838	226,950	2019/5/15
	CARLSON TRAVEL HOLDINGS	7.5	2,000	2,035	251,241	2019/8/15
	CARRIZO OIL & GAS INC	6.25	1,100	1,111	137,164	2023/4/15
	CARROLS RESTAURANT GROUP	8.0	125	131	16,242	2022/5/1
	CASE NEW HOLLAND INC	7.875	5,425	5,978	738,087	2017/12/1
	CASTLE (AM) & CO	12.75	425	404	49,978	2016/12/15
	CBC AMMO LLC/CBC FINCO	7.25	925	878	108,490	2021/11/15
	CBS OUT AMER CAP LLC/COR	5.25	850	875	108,089	2022/2/15
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	6.5	450	472	58,369	2021/4/30
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	5.75	3,500	3,561	439,671	2023/9/1
	CEB INC	5.625	1,075	1,077	133,051	2023/6/15
	CEMEX FINANCE LLC	9.375	875	979	120,882	2022/10/12
	CEMEX FINANCE LLC	6.0	100	100	12,361	2024/4/1
	CENTURY COMMUNITIES	6.875	525	517	63,844	2022/5/15
	CENTURY INTERMEDIATE HLD	9.75	1,525	1,612	199,102	2019/2/15
	CENTURYLINK INC	6.75	1,225	1,270	156,909	2023/12/1
	CENTURYLINK INC	7.6	7,650	7,229	892,523	2039/9/15
	CENVEO CORP	8.5	1,950	1,664	205,537	2022/9/15
	CEQUEL COM ESCRW 1/CAP C	6.375	3,475	3,470	428,487	2020/9/15
	CEQUEL COM HLDG 1/CAP CP	5.125	1,375	1,256	155,115	2021/12/15
	CERIDIAN CORP	11.0	950	1,012	125,057	2021/3/15
	CGG VERITAS	6.5	450	382	47,223	2021/6/1
	CHAPARRAL ENERGY INC	9.875	1,000	835	103,089	2020/10/1
	CHAPARRAL ENERGY INC	7.625	475	363	44,862	2022/11/15
	CHASSIX INC	—	1,200	1,077	132,966	2018/8/1
	CHC HELICOPTER SA	9.375	1,121	740	91,363	2021/6/1
	CHEMOURS CO	7.0	275	281	34,715	2025/5/15
	CHESAPEAKE OIL OP/FIN	6.625	900	736	90,946	2019/11/15
	CITGO HOLDING INC	10.75	2,900	3,008	371,460	2020/2/15

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)					
	CITGO PETROLEUM CORP	6.25	800	798	98,521	2022/8/15
	CITIGROUP INC	5.35	1,900	1,802	222,552	2049/5/29
	CITIGROUP INC	5.95	300	295	36,458	2049/12/29
	CITIGROUP INC	5.9	2,025	2,002	247,193	2049/12/29
	CLAYTON WILLIAMS ENERGY	7.75	375	356	43,982	2019/4/1
	CLEAR CHANNEL COM	10.0	2,375	2,078	256,565	2018/1/15
	CLEAR CHANNEL COMMUNICAT	9.0	3,550	3,460	427,216	2019/12/15
	CLEAR CHANNEL COMMUNICAT	12.0	2,335	1,810	223,476	2021/2/1
	CLEAR CHANNEL COMMUNICAT	11.25	775	779	96,279	2021/3/1
	CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	6.5	725	751	92,753	2022/11/15
	CLOUD PEAK ENRGY RES/FIN	6.375	375	286	35,417	2024/3/15
	CNG HOLDINGS INC	9.375	1,750	1,312	162,041	2020/5/15
	COEUR D'ALENE MINES CORP	7.875	1,125	967	119,447	2021/2/1
	COGENT COMM FINANCE INC	5.625	2,500	2,400	296,304	2021/4/15
	COMMERZBANK AG	8.125	500	586	72,363	2023/9/19
	COMMSCOPE HOLDINGS INC	6.625	2,975	3,079	380,148	2020/6/1
	COMMSCOPE TECH FINANCE L	6.0	1,750	1,758	217,058	2025/6/15
	COMMUNICATIONS SALES & L	8.25	750	750	92,710	2023/10/15
	COMMUNITY CHOICE FINANCI	10.75	1,275	599	73,983	2019/5/1
	COMPASS INVESTORS INC	7.75	4,625	4,671	576,712	2021/1/15
	COMPILER FINANCE SUB INC	7.0	1,350	1,029	127,086	2021/5/1
	COMPRESSCO PARTNERS/FINA	7.25	1,000	965	119,138	2022/8/15
	CONCHO RESOURCES INC	6.5	400	420	51,853	2022/1/15
	CONCORDIA HEALTHCARE COR	7.0	1,650	1,654	204,218	2023/4/15
	CONS CNT CO/CONS CNT CAP	10.125	2,975	2,692	332,400	2020/7/15
	CONSOLIDATED COMMUNICATI	6.5	1,025	1,007	124,331	2022/10/1
	CONSOLIDATED ENERGY FIN	6.75	2,800	2,870	354,330	2019/10/15
	CONSTELLATION ENTERPRISE	10.625	700	623	76,915	2016/2/1
	CONSTELLIUM NV	8.0	750	776	95,835	2023/1/15
	CONTL AIRLINES 2012-2 B	5.5	107	114	14,115	2020/10/29
	CONTL AIRLINES 2012-3 C	6.125	2,275	2,394	295,617	2018/4/29
	CONTOURGLOBAL POWER HLDG	7.125	200	209	25,864	2019/6/1
	COVANTA HOLDING CORP	5.875	725	735	90,851	2024/3/1
	COVERIS HOLDINGS SA	7.875	1,000	1,020	125,929	2019/11/1
	CPG MERGER SUB LLC	8.0	2,350	2,455	303,186	2021/10/1
	CREDIT AGRICOLE SA	7.875	200	209	25,897	2049/1/29
	CREDIT SUISSE GROUP AG	6.25	1,625	1,572	194,102	2049/12/29
	CRESCENT RESOURCES LLC	10.25	295	313	38,651	2017/8/15
	CRESTWOOD MIDSTREAM PART	6.0	500	522	64,507	2020/12/15
	CRESTWOOD MIDSTREAM PART	6.125	950	985	121,685	2022/3/1
	CROSSTEX ENERGY LP/CROSS	7.125	374	414	51,210	2022/6/1
	CYRUSONE LP/CYRUSONE FIN	6.375	625	657	81,213	2022/11/15
	DEAN FOODS CO	6.5	1,425	1,474	182,088	2023/3/15
	DENBURY RESOURCES INC	6.375	1,450	1,431	176,779	2021/8/15
	DENBURY RESOURCES INC	5.5	400	372	45,927	2022/5/1
	DENVER PARENT CORP	12.25	2,568	250	30,922	2018/8/15
	DIAMOND FOODS INC	7.0	800	824	101,731	2019/3/15

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	
	%	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)	DIGICEL GROUP LTD	8.25	3,150	3,181	392,787	2020/9/30
	DIGICEL GROUP LTD	7.125	6,200	5,921	731,006	2022/4/1
	DIGICEL LIMITED	7.0	200	208	25,679	2020/2/15
	DIGICEL LIMITED	6.0	2,275	2,234	275,928	2021/4/15
	DIGICEL LIMITED	6.75	1,400	1,377	170,035	2023/3/1
	DIRECTBUY HOLDINGS INC	12.0	587	155	19,228	2019/10/31
	DISH DBS CORP	5.875	425	423	52,339	2024/11/15
	DJO FINCO INC/DJO FINANC	8.125	1,175	1,216	150,142	2021/6/15
	DRIVETIME AUTO GP & ACCE	8.0	2,450	2,388	294,915	2021/6/1
	DUPONT FABROS TECH LP	5.875	1,200	1,239	152,966	2021/9/15
	DYNEGY FINANCE I/II INC	7.375	825	874	107,965	2022/11/1
	DYNEGY INC	5.875	1,400	1,386	171,115	2023/6/1
	EARTHLINK INC	8.875	2,625	2,743	338,666	2019/5/15
	ECO SERVICES OP/ECO FIN	8.5	1,575	1,575	194,449	2022/11/1
	EILEME 2 AB	11.625	675	755	93,294	2020/1/31
	EMECO PTY LTD	9.875	800	620	76,545	2019/3/15
	ENDEAVOR ENERGY RESOURCE	8.125	225	235	29,028	2023/9/15
	ENDO FIN LLC/ENDO FINCO	6.0	1,200	1,212	149,633	2025/2/1
	ENDO FINANCE LLC	5.75	875	888	109,647	2022/1/15
	ENERGY FUTURE/EFIH FINAN	—	971	1,098	135,596	2022/3/1
	ENERGY TRANSFER EQUITY	5.875	725	761	93,983	2024/1/15
	ENERGY XXI GULF COAST IN	7.75	675	291	36,042	2019/6/15
	ENERGY XXI GULF COAST IN	11.0	2,500	2,281	281,643	2020/3/15
	ENERGY XXI GULF COAST IN	7.5	350	128	15,880	2021/12/15
	ENTEGRIS INC	6.0	475	492	60,769	2022/4/1
	EP ENER/EVEREST ACQ FIN	6.375	1,400	1,408	173,924	2023/6/15
	ERICKSON INC	8.25	1,554	1,181	145,811	2020/5/1
	EXCO RESOURCES INC	8.5	1,450	848	104,724	2022/4/15
	EXOPACK HOLDNG CORP	10.0	1,300	1,374	169,726	2018/6/1
	FELCOR LODGING LP	6.0	450	461	56,945	2025/6/1
	FERRELLGAS LP/FERRELLGAS	6.75	2,875	2,932	362,046	2022/1/15
	FERRELLGAS LP/FERRELLGAS	6.75	1,475	1,486	183,469	2023/6/15
	FERRELLGAS PARTNERS LP	8.625	520	542	66,927	2020/6/15
	FIRST CASH FINANCIAL SER	6.75	90	96	11,875	2021/4/1
	FIRST DATA CORPORATION	10.625	1,999	2,238	276,412	2021/6/15
	FIRST QUANTUM	6.75	2,275	2,198	271,392	2020/2/15
	FIRST QUANTUM	7.0	475	458	56,590	2021/2/15
	FIRST QUANTUM MINERALS L	7.25	400	403	49,754	2019/10/15
	FLASH DUTCH 2 BV & US CO	7.375	2,150	2,322	286,674	2021/5/1
	FLEXI-VAN LEASNG	7.875	1,550	1,596	197,103	2018/8/15
	FLORIDA EAST COAST HLDGS	6.75	725	721	89,060	2019/5/1
	FLORIDA EAST COAST HLDGS	9.75	375	359	44,329	2020/5/1
	FLY LEASING LTD	6.75	200	206	25,494	2020/12/15
	FMG RESOURCES AUG 2006	8.25	825	761	93,960	2019/11/1
	FORBES ENERGY SERVICES	9.0	1,825	1,491	184,194	2019/6/15
	FREESCALE SEMICONDUCTOR	5.0	225	234	28,959	2021/5/15
	FRONTIER COMMUNICATIONS	7.125	1,000	1,042	128,707	2019/3/15

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	
		%	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)					
	FRONTIER COMMUNICATIONS	7.625	175	165	20,417	2024/4/15
	GARDA WORLD SECURITY COR	7.25	3,825	3,767	465,150	2021/11/15
	GARDA WORLD SECURITY COR	7.25	2,800	2,758	340,502	2021/11/15
	GENCORP INC	7.125	2,225	2,389	294,957	2021/3/15
	GENON ESCROW CORP	9.5	1,898	1,969	243,114	2018/10/15
	GENON ESCROW CORP	9.875	1,500	1,552	191,671	2020/10/15
	GEO GROUP INC/THE	5.875	975	1,028	126,994	2022/1/15
	GIBRALTAR STEEL CORP OF	6.25	450	462	57,084	2021/2/1
	GIBSON ENERGY INC	6.75	775	796	98,312	2021/7/15
	GLOBAL BRASS AND COPPER	9.5	1,600	1,758	217,042	2019/6/1
	GLOBAL PART/GLP FINANCE	6.25	700	686	84,693	2022/7/15
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	5.7	400	401	49,532	2049/12/29
	GRAFTECH INTERNATIONAL	6.375	675	627	77,462	2020/11/15
	GRATON ECONOMIC DEV AUTH	9.625	275	299	36,964	2019/9/1
	GRAY TELEVISION INC	7.5	4,025	4,306	531,711	2020/10/1
	GREAT LAKES DREDGE&DOCK	7.375	25	25	3,163	2019/2/1
	GREIF INC	7.75	720	802	99,113	2019/8/1
	GRIFFON CORPORATION	5.25	1,000	1,003	123,922	2022/3/1
	GYMBOREE CORP	9.125	1,650	738	91,159	2018/12/1
	H&E EQUIPMENT SERVICES	7.0	975	1,023	126,392	2022/9/1
	HALCON RESOURCES CORP	9.75	1,725	1,259	155,467	2020/7/15
	HALCON RESOURCES CORP	8.875	1,500	1,074	132,642	2021/5/15
	HALYARD HEALTH INC	6.25	1,925	2,024	249,989	2022/10/15
	HAPAG-LLOYD AG	9.75	150	156	19,352	2017/10/15
	HARBINGER GROUP INC	7.75	2,325	2,293	283,097	2022/1/15
	HARDWOODS ACQUISITION IN	7.5	4,450	4,316	532,915	2021/8/1
	HARLAND CLARKE HLDINGS	6.875	825	820	101,345	2020/3/1
	HARLAND CLARKE HOLDINGS	9.75	400	421	52,038	2018/8/1
	HARLAND ESCROW CORP	9.25	11,075	10,341	1,276,734	2021/3/1
	HARRAHS OPERATING CO INC	—	1,957	538	66,443	2016/2/1
	HARRON COMM/HARRON FIN	9.125	1,600	1,742	215,067	2020/4/1
	HAWKER BEECHCRAFT ESCROW	—	200	—	—	2017/4/1
	HCA HOLDINGS INC	6.25	850	918	113,336	2021/2/15
	HD SUPPLY INC	11.5	1,325	1,548	191,189	2020/7/15
	HD SUPPLY INC	7.5	2,950	3,174	391,977	2020/7/15
	HEADWATERS INC	7.25	1,550	1,623	200,452	2019/1/15
	HEARTHSIDE GROUP HLDS/FI	6.5	1,450	1,428	176,331	2022/5/1
	HECLA MINING CO	6.875	2,150	2,042	252,167	2021/5/1
	HELLAS II	—	1,700	—	—	2015/1/15
	HERCULES OFFSHORE INC	10.25	1,000	340	41,976	2019/4/1
	HERCULES OFFSHORE INC	7.5	5,650	1,751	216,240	2021/10/1
	HERCULES OFFSHORE INC	6.75	1,100	338	41,760	2022/4/1
	HEXION US FIN/NOVA SCOTI	9.0	7,425	5,568	687,517	2020/11/15
	HEXION US FINANCE CORP	6.625	325	303	37,416	2020/4/15
	HILAND PART LP/CORP	5.5	550	572	70,653	2022/5/15
	HILCORP ENERGY I/HILCORP	7.625	500	523	64,662	2021/4/15
	HILLMAN GROUP INC	6.375	1,500	1,477	182,412	2022/7/15

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	
		%	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)	HOCKEY MERGER SUB 2 INC	7.875	5,025	5,163	637,447	2021/10/1
	HOLOGIC INC	6.25	500	517	63,939	2020/8/1
	HRG GROUP INC	7.875	650	685	84,662	2019/7/15
	HRG GROUP INC	7.75	850	838	103,498	2022/1/15
	HUB HOLDINGS LLC/HUB HOL	8.125	1,800	1,786	220,561	2019/7/15
	HUNT COS INC	9.625	1,875	1,968	243,061	2021/3/1
	HUNTINGTON INGALLS INDUS	7.125	450	480	59,307	2021/3/15
	IAMGOLD CORP	6.75	1,150	968	119,617	2020/10/1
	ICAHN ENTERPRISES/FIN	6.0	299	316	39,083	2020/8/1
	ICON HEALTH & FITNESS	11.875	2,175	2,196	271,210	2016/10/15
	IFM US COLONIAL PIPELINE	6.45	250	269	33,299	2021/5/1
	IGLOO HOLDINGS CORP	8.25	5,250	5,328	657,887	2017/12/15
	IHEARTCOMMUNICATIONS INC	10.625	1,150	1,132	139,849	2023/3/15
	ILFC E-CAPITAL TRUST I	4.09	500	491	60,726	2065/12/21
	ILLINOIS PWR GENERATING	7.0	550	525	64,847	2018/4/15
	IMS HEALTH INC	6.0	825	858	105,928	2020/11/1
	INEOS GROUP HOLDINGS SA	6.125	1,426	1,477	182,435	2018/8/15
	INFOR SOFTWARE PARENT	7.125	1,850	1,875	231,541	2021/5/1
	INFOR US INC	6.5	650	671	82,957	2022/5/15
	INN OF THE MOUNTAIN GODS	9.25	1,627	1,522	188,013	2020/11/30
	INTELSAT LUXEMBOURG SA	6.75	575	559	69,126	2018/6/1
	INTELSAT LUXEMBOURG SA	8.125	5,425	4,750	586,467	2023/6/1
	INTERACTIVE DATA CORP	5.875	225	228	28,195	2019/4/15
	INTERGEN NV	7.0	2,750	2,612	322,539	2023/6/30
	INTERLINE BRANDS INC	10.0	898	942	116,410	2018/11/15
	INTL LEASE FINANCE CORP	5.875	1,125	1,209	149,309	2019/4/1
	INTL LEASE FINANCE CORP	8.25	1,575	1,878	231,881	2020/12/15
	INTL LEASE FINANCE CORP	8.625	725	894	110,431	2022/1/15
	INTREPID AVIATION GRP HL	6.875	1,375	1,289	159,147	2019/2/15
	INVENTIV HEALTH INC	9.0	1,050	1,099	135,709	2018/1/15
	INVENTIV HEALTH INC	11.0	283	274	33,891	2018/8/15
	INVENTIV HEALTH INC	11.0	618	590	72,864	2018/8/15
	INVENTIV HEALTH INC	10.0	1,323	1,360	167,948	2018/8/15
	ISLE OF CAPRI CASINOS	8.875	2,150	2,354	290,655	2020/6/15
	ITALICS MERGER SUB	7.125	2,200	2,189	270,253	2023/7/15
	ITHACA ENERGY INC	8.125	1,800	1,615	199,449	2019/7/1
	JAC HOLDING CORP	11.5	775	802	99,030	2019/10/1
	JACK COOPER HOLDINGS COR	10.25	3,325	3,009	371,506	2020/6/1
	JAGUAR HOLDING CO I	9.375	1,350	1,383	170,837	2017/10/15
	JAMES RIVER ESCROW INC	—	475	1	183	2019/4/1
	JBS INVESTMENTS GMBH	7.75	800	886	109,434	2020/10/28
	JBS INVESTMENTS GMBH	7.25	1,800	1,894	233,894	2024/4/3
	JBS USA LLC/JBS USA FINA	8.25	1,150	1,229	151,740	2020/2/1
	JBS USA LLC/JBS USA FINA	7.25	2,000	2,120	261,735	2021/6/1
	JC PENNEY CORP INC	8.125	1,000	1,005	124,077	2019/10/1
	JCH PARENT INC	10.5	1,688	1,249	154,299	2019/3/15
	JLL/DELTA DUTCH PLEDGECO	8.75	2,000	2,045	252,475	2020/5/1

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)	JMC STEEL GROUP	8.25	550	502	62,046	2018/3/15
	JPMORGAN CHASE & CO	6.1	825	835	103,112	2049/10/29
	JPMORGAN CHASE & CO	6.0	1,625	1,633	201,625	2049/12/29
	JPMORGAN CHASE & CO	6.125	3,450	3,493	431,261	2049/12/29
	JURASSIC HOLDINGS III	6.875	2,600	2,145	264,821	2021/2/15
	K HOVNIANIAN ENTERPRISES	11.875	375	386	47,686	2015/10/15
	K HOVNIANIAN ENTERPRISES	7.0	625	587	72,532	2019/1/15
	K HOVNIANIAN ENTERPRISES	7.5	972	1,001	123,603	2016/5/15
	K. HOVNIANIAN ENTERPRISES	6.25	1,700	1,717	211,980	2016/1/15
	KB HOME	7.0	1,350	1,397	172,504	2021/12/15
	KEHE DISTRIBUTORS LLC/FI	7.625	1,550	1,650	203,801	2021/8/15
	KENAN ADVANTAGE GROUP	8.375	600	625	77,224	2018/12/15
	KINDRED ESCROW CORP II	8.0	850	913	112,811	2020/1/15
	KINDRED HEALTHCARE INC	6.375	1,925	1,939	239,442	2022/4/15
	KISSNER MILLING CO LTD	7.25	3,175	3,246	400,805	2019/6/1
	KOSMOS ENERGY LTD	7.875	1,200	1,170	144,448	2021/8/1
	LADDER CAP FIN LLC/CORP	7.375	1,350	1,417	175,004	2017/10/1
	LANDRY'S HOLDINGS II INC	10.25	4,425	4,613	569,528	2018/1/1
	LANDRY'S INC	9.375	3,105	3,347	413,290	2020/5/1
	LAREDO PETROLEUM INC	7.375	1,000	1,070	132,102	2022/5/1
	LAREDO PETROLEUM INC	6.25	700	717	88,582	2023/3/15
	LBC TANK TERMINAL HLDING	6.875	575	598	73,829	2023/5/15
	LBG CAPITAL NO.1 PLC	8.0	80	92	11,383	2049/12/29
	LEAR CORP	5.375	1,375	1,405	173,577	2024/3/15
	LEE ENTERPRISES INC	9.5	675	690	85,210	2022/3/15
	LENNAR CORP	12.25	950	1,128	139,278	2017/6/1
	LENNAR CORP	6.95	1,700	1,874	231,394	2018/6/1
	LEVEL 3 FINANCING INC	6.125	2,450	2,582	318,889	2021/1/15
	LIFEPOINT HOSPITALS INC	5.5	1,450	1,515	187,072	2021/12/1
	LIMITED BRANDS INC	5.625	800	856	105,681	2022/2/15
	LIN TELEVISION CORP	6.375	625	644	79,573	2021/1/15
	LINN ENERGY LLC/FIN CORP	6.25	300	253	31,250	2019/11/1
	LINN ENERGY LLC/FIN CORP	8.625	2,550	2,256	278,618	2020/4/15
	LOGO MERGER SUB CORP	8.375	3,300	3,390	418,621	2020/10/15
	LONESTAR RESOURCES AMERI	8.75	1,500	1,218	150,466	2019/4/15
	LOUISIANA PACIFIC CORP	7.5	725	772	95,326	2020/6/1
	LTF MERGER SUB INC	8.5	3,275	3,250	401,299	2023/6/15
	LUNDIN MINING CORP	7.875	475	514	63,481	2022/11/1
	LYNX I CORP	5.375	945	976	120,607	2021/4/15
	MANITOWOC COMPANY INC	8.5	750	800	98,845	2020/11/1
	MANITOWOC COMPANY INC	5.875	475	514	63,481	2022/10/15
	MARFRIG HOLDING EUROPE B	6.875	200	184	22,778	2019/6/24
	MARIPOSA BOR / MERG SUB	8.75	2,325	2,511	310,008	2021/10/15
	MATADOR RESOURCES CO	6.875	525	538	66,436	2023/4/15
	MATTAMY GROUP CORP	6.5	1,100	1,086	134,108	2020/11/15
	MDC HOLDINGS INC	6.0	3,400	2,924	360,997	2043/1/15
	MDC PARTNERS INC	6.75	850	847	104,678	2020/4/1

銘柄	当	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)	MEDIACOM BRDBND LLC/CORP	5.5	675	667	82,397	2021/4/15
	MEDIACOM BRDBND LLC/CORP	6.375	850	867	107,039	2023/4/1
	MEG ENERGY CORP	6.375	575	536	66,197	2023/1/30
	MERISANT ESCROW	12.25	600	—	—	2014/5/15
	MERITAGE HOMES CORP	7.0	360	383	47,334	2022/4/1
	MERITAGE HOMES CORP	6.0	875	883	109,107	2025/6/1
	MGM RESORTS INTL	10.0	1,750	1,933	238,740	2016/11/1
	MGM RESORTS INTL	8.625	3,350	3,827	472,527	2019/2/1
	MGM RESORTS INTL	6.75	1,168	1,255	155,016	2020/10/1
	MGM RESORTS INTL	7.75	1,150	1,283	158,491	2022/3/15
	MHGE PARENT LLC/FINANCE	8.5	5,725	5,875	725,362	2019/8/1
	MICHAEL BAKER HLDINGS/FI	8.875	900	832	102,780	2019/4/15
	MIDAS INT HOLDCO II/FIN	7.875	2,225	2,236	276,071	2022/10/1
	MIDSTATES PETRO INC/LLC	10.75	1,290	619	76,446	2020/10/1
	MIDSTATES PETRO INC/LLC	9.25	2,675	1,243	153,568	2021/6/1
	MIDWEST VANADIUM PTY LTD	12.25	150	8	1,018	2018/2/15
	MILACRON LLC/MCRON FIN	7.75	3,975	4,114	507,929	2021/2/15
	MILLAR WESTERN FOREST	8.5	625	615	76,005	2021/4/1
	MONITRONICS INTERNATIONA	9.125	850	843	104,101	2020/4/1
	MOOD MEDIA CORP	9.25	900	769	95,002	2020/10/15
	MPG HOLDCO I INC	7.375	725	770	95,102	2022/10/15
	MPH ACQUISITION HOLDINGS	6.625	1,750	1,844	227,667	2022/4/1
	MPL 2 ACQUISITION CANCO	9.875	1,050	1,109	136,924	2018/8/15
	MPT OPER PARTNERSP/FINL	6.875	1,050	1,124	138,869	2021/5/1
	MPT OPER PARTNERSP/FINL	6.375	1,325	1,424	175,853	2022/2/15
	MRT MID PART/MRT MID FIN	7.25	1,650	1,641	202,690	2021/2/15
	MU FINANCE PLC	8.375	1,643	1,687	208,327	2017/2/1
	MURRAY ENERGY CORP	11.25	600	525	64,816	2021/4/15
	MUSTANG MERGER CORP	8.5	2,525	2,575	317,971	2021/8/15
	NANA DEVELOPMENT CORP	9.5	775	740	91,375	2019/3/15
	NATHAN'S FAMOUS INC	10.0	1,300	1,410	174,140	2020/3/15
	NATIONAL CINEMEDIA LLC	7.875	850	894	110,450	2021/7/15
	NATIONAL CINEMEDIA LLC	6.0	1,100	1,145	141,407	2022/4/15
	NATIONSTAR MORT/CAP CORP	6.5	1,775	1,794	221,606	2018/8/1
	NATIONSTAR MORT/CAP CORP	7.875	325	327	40,375	2020/10/1
	NATIONSTAR MORT/CAP CORP	6.5	3,975	3,721	459,467	2022/6/1
	NAVISTAR INTL CORP	8.25	3,325	3,250	401,268	2021/11/1
	NBTY INC	9.0	750	780	96,298	2018/10/1
	NCI BUILDING SYSTEMS INC	8.25	475	508	62,748	2023/1/15
	NCR CORP	5.875	700	711	87,826	2021/12/15
NCR CORP	6.375	1,500	1,539	190,051	2023/12/15	
NEOVIA LOGISTICS INT HLD	10.0	2,425	2,443	301,635	2018/2/15	
NES RENTALS HOLDINGS	7.875	3,600	3,681	454,456	2018/5/1	
NEW ACAD FIN CO/FIN CORP	8.0	500	507	62,694	2018/6/15	
NEW ENTERPRISE STONE & L	13.0	1,774	1,918	236,825	2018/3/15	
NEW ENTERPRISE STONE & L	11.0	700	630	77,779	2018/9/1	
NFR ENERGY LLC/FIN CORP	9.75	1,050	183	22,685	2017/2/15	

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	
		%	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)	NORANDA ALUMINUM ACQUISIT	11.0	2,475	2,338	288,757	2019/6/1
	NORBORD INC	6.25	875	883	109,107	2023/4/15
	NORTEK INC	8.5	2,425	2,606	321,844	2021/4/15
	NOVELIS INC	8.75	3,000	3,174	391,910	2020/12/15
	NPC INTL/OPER CO A&B INC	10.5	550	578	71,467	2020/1/15
	NRG ENERGY INC	6.25	2,475	2,549	314,730	2022/7/15
	NUMERICABLE GROUP SA	6.0	2,350	2,344	289,405	2022/5/15
	NWH ESCROW CORP	7.5	1,900	1,795	221,672	2021/8/1
	OASIS PETROLEUM INC	6.5	1,050	1,052	129,957	2021/11/1
	OPPENHEIMER HOLDINGS INC	8.75	678	708	87,472	2018/4/15
	ORTHO-CLINICAL DIAGNOSTI	6.625	4,375	3,844	474,645	2022/5/15
	OWENS CORNING INC	7.0	2,175	2,493	307,839	2036/12/1
	OWENS-BROCKWAY	7.375	321	337	41,612	2016/5/15
	OWENS-ILLINOIS INC	7.8	600	680	83,994	2018/5/15
	PALACE ENT HLDG LLC/CORP	8.875	1,075	1,090	134,627	2017/4/15
	PAPERWORKS INDUSTRIES IN	9.5	2,050	2,062	254,674	2019/8/15
	PAR PHARMACEUTICAL COS I	7.375	950	1,012	125,057	2020/10/15
	PARAMOUNT RESOURCES LTD	6.875	1,250	1,253	154,710	2023/6/30
	PARKER DRILLING CO	6.75	1,175	1,022	126,206	2022/7/15
	PATRIOT MERGER CORP	9.0	3,400	3,421	422,387	2021/7/15
	PBF LOGISTICS LP/FINANCE	6.875	1,075	1,089	134,544	2023/5/15
	PEABODY ENERGY CORP	6.0	2,575	1,364	168,492	2018/11/15
	PEABODY ENERGY CORP	6.25	1,275	510	62,964	2021/11/15
	PEABODY ENERGY CORP	10.0	525	341	42,130	2022/3/15
	PENN NATIONAL GAMING INC	5.875	148	150	18,591	2021/11/1
	PENN VIRGINIA RESOURCE	6.5	1,075	1,156	142,734	2021/5/15
	PENSKE AUTO GROUP INC	5.75	975	1,023	126,392	2022/10/1
	PERSTORP HOLDING AB	8.75	500	523	64,662	2017/5/15
	PETCO HOLDINGS INC	8.5	6,075	6,272	774,395	2017/10/15
	PETROBAKKEN ENERGY LTD	8.625	900	633	78,196	2020/2/1
	PINNACLE MERGER SUB INC	9.5	1,320	1,488	183,745	2023/10/1
	PIONEER ENERGY SERVICES	6.125	975	799	98,706	2022/3/15
	PNK FINANCE CORP	6.375	3,475	3,700	456,910	2021/8/1
	POLYMER GROUP INC	6.875	1,150	1,068	131,862	2019/6/1
	POST HOLDINGS INC	6.75	1,700	1,666	205,684	2021/12/1
	POST HOLDINGS INC	7.375	625	628	77,644	2022/2/15
	POST HOLDINGS INC	6.0	2,304	2,151	265,606	2022/12/15
	PRISO ACQUISITION CORP	9.0	2,700	2,666	329,175	2023/5/15
	PROSPECT HLDG LLC/FINANC	10.25	1,650	1,138	140,559	2018/10/1
	QUADRA FNX MINING LTD	7.75	625	649	80,152	2019/6/15
	QUEBECOR MEDIA INC	5.75	825	834	103,000	2023/1/15
	QUICKSILVER RESOURCES IN	—	600	88	10,972	2019/8/15
	QUICKSILVER INC/QS WHOLES	10.0	1,250	600	74,076	2020/8/1
	QVC INC	5.125	125	128	15,916	2022/7/2
	QWEST CORPORATION	7.25	425	438	54,103	2035/10/15
	RADIO SYSTEMS CORP	8.375	750	802	99,076	2019/11/1
	RAIN CII CARBON LLC/CII	8.25	425	410	50,699	2021/1/15

銘柄	当	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	
	%	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)	RCN TELECM SER/CAPITAL	8.5	3,850	4,095	505,622	2020/8/15
	REGAL ENTERTAINMENT GRP	5.75	875	883	109,107	2023/6/15
	RENAISSANCE ACQUISITION	6.875	3,200	2,960	365,441	2021/8/15
	RESOLUTE FOREST PRODUCTS	5.875	4,325	3,935	485,907	2023/5/15
	REXEL	6.125	900	952	117,572	2019/12/15
	REYNOLDS GROUP HOLDINGS	6.875	400	420	51,853	2021/2/15
	REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD	9.875	1,968	2,087	257,699	2019/8/15
	RITE AID CORP	6.125	3,050	3,152	389,261	2023/4/1
	RITE AID CORP	7.7	925	1,086	134,185	2027/2/15
	RITE AID CORP	6.875	1,250	1,412	174,387	2028/12/15
	ROYAL BK SCOTLAND GRP PLC	7.64	2,950	3,200	395,164	2049/3/29
	RR DONNELLEY & SONS CO	7.875	675	773	95,523	2021/3/15
	RR DONNELLEY & SONS CO	7.0	1,100	1,207	149,047	2022/2/15
	RR DONNELLEY & SONS CO	6.5	525	552	68,219	2023/11/15
	RR DONNELLEY & SONS CO	6.0	925	948	117,055	2024/4/1
	RRI ENERGY	7.875	225	230	28,472	2017/6/15
	RUE21 INC	9.0	1,125	1,012	125,003	2021/10/15
	RYLAND GROUP	6.625	675	737	91,044	2020/5/1
	RYLAND GROUP	5.375	400	398	49,137	2022/10/1
	SABINE PASS LIQUEFACTION	5.625	100	102	12,670	2021/2/1
	SABINE PASS LNG LP	7.5	775	822	101,541	2016/11/30
	SABRA HEALTH/CAPTL CORP	5.5	925	971	119,910	2021/2/1
	SANCHEZ ENERGY CORP	7.75	4,825	4,882	602,842	2021/6/15
	SANDRIDGE ENERGY INC	7.5	1,300	702	86,668	2021/3/15
	SANDRIDGE ENERGY INC	8.125	975	516	63,797	2022/10/15
	SANDRIDGE ENERGY INC	7.5	1,800	945	116,669	2023/2/15
	SANJEL CORP	7.5	900	668	82,502	2019/6/19
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5.625	50	52	6,489	2019/10/1
	SCHAEFFLER HLDG FIN BV	6.875	700	728	89,986	2018/8/15
	SCIENTIFIC GAMES INTERNA	10.0	1,050	1,018	125,744	2022/12/1
	SEALED AIR CORP	8.375	475	538	66,443	2021/9/15
	SEALED AIR CORP	5.25	475	484	59,816	2023/4/1
	SEITEL INC	9.5	1,350	1,208	149,170	2019/4/15
	SELECT MEDICAL CORP	6.375	475	483	59,658	2021/6/1
	SERVICE CORP INTL	8.0	1,250	1,468	181,331	2021/11/15
	SERVICE CORP INTL	5.375	2,600	2,759	340,657	2022/1/15
	SERVICE CORP INTL	5.375	825	862	106,437	2024/5/15
	SEVENTY SEVEN ENE	6.5	1,250	812	100,311	2022/7/15
	SIDEWINDER DRILLING INC	9.75	900	589	72,779	2019/11/15
	SIGNODE INDUSTRIAL GROUP	6.375	1,850	1,831	226,116	2022/5/1
	SINCLAIR TELEVISION GROU	5.375	800	823	101,607	2021/4/1
	SINCLAIR TELEVISION GROU	6.375	1,775	1,881	232,289	2021/11/1
	SLM CORP	8.0	7,450	8,390	1,035,852	2020/3/25
	SLM CORP	7.25	1,250	1,346	166,285	2022/1/25
	SLM CORP	6.125	2,975	2,893	357,192	2024/3/25
	SM ENERGY CO	6.5	125	131	16,204	2021/11/15
	SM ENERGY CO	6.5	425	446	55,094	2023/1/1

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)					
	SOCIETE GENERALE	6.0	200	188	23,303	2049/10/27
	SOCIETE GENERALE	6.0	400	377	46,606	2049/12/31
	SONIC AUTOMOTIVE INC	7.0	3,000	3,255	401,862	2022/7/15
	SONIC AUTOMOTIVE INC	5.0	725	719	88,837	2023/5/15
	SOPHIA HOLDING FIN LP/IN	9.625	200	203	25,154	2018/12/1
	SPECTRUM BRANDS HLDGS	6.75	175	184	22,782	2020/3/15
	SPECTRUM BRANDS INC	6.375	275	294	36,328	2020/11/15
	SPECTRUM BRANDS INC	6.625	625	670	82,756	2022/11/15
	SPENCER SPIRIT HOLDINGS	9.0	2,883	2,926	361,274	2018/5/1
	SPIRIT AEROSYSTEMS INC	6.75	600	629	77,687	2020/12/15
	SPRINT CAPITAL CORP	6.9	900	931	115,002	2019/5/1
	SPRINT CAPITAL CORP	6.875	325	287	35,510	2028/11/15
	SPRINT CAPITAL CORP	8.75	5,775	5,738	708,525	2032/3/15
	SPRINT CORP	7.875	600	599	73,983	2023/9/15
	SPRINT NEXTEL CORP	7.0	500	546	67,517	2020/3/1
	SPRINT NEXTEL CORP	11.5	5,850	7,020	866,689	2021/11/15
	SRA INTERNATIONAL INC	11.0	1,075	1,144	141,346	2019/10/1
	ST BARBARA LTD	8.875	325	303	37,416	2018/4/15
	STANDARD PACIFIC CORP	8.375	3,750	4,350	537,051	2021/1/15
	STEEL DYNAMICS INC	6.125	450	476	58,820	2019/8/15
	STEEL DYNAMICS INC	6.375	2,350	2,505	309,352	2022/8/15
	SUBURBAN PROPANE PARTNRS	5.5	1,825	1,866	230,384	2024/6/1
	SUGAR HSP GMNG PROP/FIN	6.375	1,050	1,000	123,475	2021/6/1
	SUMMIT MATERIALS LLC/FIN	10.5	675	740	91,460	2020/1/31
	SUMMIT MID HLDS LLC / FI	7.5	2,075	2,194	270,909	2021/7/1
	SUN MERGER SUB INC	5.25	800	818	101,089	2018/8/1
	SUNCOKE ENRGY PART LP/FI	7.375	525	536	66,274	2020/2/1
	SUNCOKE ENRGY PART LP/FI	7.375	1,000	1,022	126,237	2020/2/1
	SUNGARD AVAIL SERV CAP	8.75	1,750	1,312	162,041	2022/4/1
	SUNGARD DATA SYSTEMS INC	7.375	1,000	1,040	128,490	2018/11/15
	SUNGARD DATA SYSTEMS INC	6.625	3,950	4,117	508,392	2019/11/1
	SUNOCO LP/FINANCE CORP	6.375	2,325	2,429	299,961	2023/4/1
	SYNCREON GROUP BV/SYNCRE	8.625	3,950	3,081	380,380	2021/11/1
	T-MOBILE USA INC	6.464	475	492	60,769	2019/4/28
	T-MOBILE USA INC	6.25	275	283	35,054	2021/4/1
	T-MOBILE USA INC	6.731	975	1,029	127,144	2022/4/28
	TALOS PRODUCTION LLC/FIN	9.75	2,600	2,301	284,081	2018/2/15
	TARGA RESOURCES PARTNERS	6.875	425	447	55,225	2021/2/1
	TAYLOR MORRISON COMM/MON	5.625	1,450	1,410	174,094	2024/3/1
	TEMPEL STEEL COMPANY	12.0	1,025	937	115,790	2016/8/15
	TENET HEALTHCARE CORP	3.780291	475	481	59,449	2020/6/15
	TENET HEALTHCARE CORP	8.125	2,850	3,124	385,727	2022/4/1
	TESORO LOGISTICS LP/CORP	5.875	528	551	68,120	2020/10/1
	TESORO LOGISTICS LP/CORP	6.125	2,575	2,716	335,394	2021/10/15
	THC ESCROW CORP II	6.75	1,575	1,598	197,366	2023/6/15
	THOMPSON CREEK METALS CO	9.75	700	731	90,256	2017/12/1
	THOMPSON CREEK METALS CO	7.375	525	443	54,769	2018/6/1

銘柄	当	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)	THOMPSON CREEK METALS CO	12.5	425	403	49,846	2019/5/1
	TITAN INTERNATIONAL INC	6.875	1,800	1,692	208,894	2020/10/1
	TMS INTERNATIONAL CORP	7.625	475	465	57,470	2021/10/15
	TMX FIN LLC/TITLEMAX FIN	8.5	1,955	1,598	197,315	2018/9/15
	TOLL BROS FINANCE CORP	6.75	300	336	41,575	2019/11/1
	TOLL BROS FINANCE CORP	5.625	875	931	115,049	2024/1/15
	TOPAZ MARINE SA	8.625	400	394	48,643	2018/11/1
	TOPS HOLDING II CORP	8.75	1,741	1,745	215,481	2018/6/15
	TOPS HOLDING/MARKETS II	8.0	1,300	1,300	160,498	2022/6/15
	TOWNSQUARE MEDIA INC	6.5	1,225	1,223	151,049	2023/4/1
	TPC GROUP INC	8.75	1,525	1,456	179,804	2020/12/15
	TRAC INTERMODAL LLC/CORP	11.0	775	845	104,412	2019/8/15
	TRANSDIGM INC	6.0	2,575	2,584	319,101	2022/7/15
	TRANSDIGM INC	6.5	150	150	18,565	2024/7/15
	TRANSFIELD SERVICES LTD	8.375	925	989	122,194	2020/5/15
	TRANSUNION HOLDING CO	8.125	2,175	2,234	275,909	2018/6/15
	TRIANGLE USA PETROLEUM	6.75	3,250	2,673	330,024	2022/7/15
	TRINIDAD DRILLING LTD	7.875	425	429	52,995	2019/1/15
	TRINSEO OP / TRINSEO FIN	6.75	400	409	50,495	2022/5/1
	TULLOW OIL PLC	6.0	900	814	100,558	2020/11/1
	TULLOW OIL PLC	6.25	2,800	2,520	311,119	2022/4/15
	U. S. FOODSERVICE	8.5	1,175	1,231	152,101	2019/6/30
	UAL 2009-2A PASS THRU TR	9.75	949	1,037	128,103	2018/7/15
	UNIFRAX I LLC/UNIFRAX HO	7.5	4,250	4,303	531,263	2019/2/15
	UNIFRAX I LLC/UNIFRAX HO	7.5	1,275	1,290	159,379	2019/2/15
	UNIT CORP	6.625	1,150	1,109	137,009	2021/5/15
	UNITED REFINING	10.5	237	250	30,971	2018/2/28
	UNITED RENTALS NORTH AM	7.375	1,409	1,514	187,001	2020/5/15
	UNITYMEDIA HESSEN / NRW	5.5	1,875	1,947	240,457	2023/1/15
	UNITYMEDIA KABELBW GMBH	6.125	2,200	2,304	284,513	2025/1/15
	UNIVERSAL HOSPITAL SERVI	7.625	1,325	1,232	152,133	2020/8/15
	UNIVISION COMMUNICATIONS	6.75	1,421	1,540	190,129	2022/9/15
	US AIRWAYS 2012-2B PTT	6.75	201	214	26,432	2021/6/3
	US AIRWAYS 2012-2C PTT	5.45	300	305	37,686	2018/6/3
	US AIRWAYS GROUP INC	6.125	1,425	1,473	181,868	2018/6/1
	US STEEL CORP	6.875	300	306	37,871	2021/4/1
	VANDER INTERMEDIATE HOLD	9.75	650	646	79,847	2019/2/1
	VERSO PAPER HLDGS LLC/IN	11.75	1,450	1,007	124,416	2019/1/15
	VIASAT INC	6.875	1,725	1,830	226,012	2020/6/15
	VIKING CRUISES LTD	8.5	1,900	2,128	262,722	2022/10/15
	VIKING CRUISES LTD	6.25	500	498	61,498	2025/5/15
	VISANT CORP	10.0	1,550	1,271	156,917	2017/10/1
	VPII ESCROW CORP	6.75	1,400	1,481	182,894	2018/8/15
	VPII ESCROW CORP	7.5	1,725	1,875	231,603	2021/7/15
	VRX ESCROW CORP	6.125	1,410	1,454	179,572	2025/4/15
	VTR FINANCE BV	6.875	1,800	1,838	226,950	2024/1/15
	WARREN RESOURCES INC	9.0	3,200	1,600	197,536	2022/8/1

銘柄	銘柄	当期期末				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)					
	WATERJET HOLDINGS INC	7.625	400	420	51,853	2020/2/1
	WAVE HOLDCO LLC/CORP	8.25	975	994	122,780	2019/7/15
	WAVEDIVISION ESCROW/WAVE	8.125	575	609	75,248	2020/9/1
	WELLCARE HEALTH PLANS IN	5.75	775	815	100,704	2020/11/15
	WELLS FARGO & COMPANY	5.9	1,000	1,013	125,077	2049/12/29
	WHITING PETROLEUM CORP	6.25	150	152	18,796	2023/4/1
	WIDEOPENWEST FIN/CAPITAL	13.375	5,000	5,475	675,943	2019/10/15
	WILLIAM LYON HOMES INC	5.75	425	429	52,995	2019/4/15
	WILLIAM LYON HOMES INC	8.5	2,425	2,631	324,838	2020/11/15
	WIND ACQUISITION FIN SA	7.375	2,000	2,080	256,796	2021/4/23
	WINDSTREAM CORP	7.75	750	746	92,119	2020/10/15
	WINDSTREAM CORP	7.5	3,625	3,212	396,634	2022/6/1
	WINDSTREAM CORP	7.5	5,090	4,479	553,002	2023/4/1
	WINDSTREAM CORP	6.375	7,775	6,394	789,518	2023/8/1
	WINDSTREAM HLDGS MIDWEST	6.75	1,375	1,320	162,967	2028/4/1
	WISE HLDG/FIN CORP	9.75	400	432	53,396	2019/6/15
	WISE METALS GROUP LLC/WI	8.75	1,100	1,174	144,972	2018/12/15
	WMG ACQUISITION CORP	5.625	200	202	25,000	2022/4/15
	WMG ACQUISITION CORP	6.75	900	866	106,947	2022/4/15
	WMG HOLDINGS CORP	13.75	600	655	80,928	2019/10/1
	WOODSIDE HOMES CO LLC/FI	6.75	400	383	47,285	2021/12/15
	XPO LOGISTICS INC	7.875	425	455	56,274	2019/9/1
	XPO LOGISTICS INC	6.5	2,475	2,457	303,348	2022/6/15
	ZAYO GROUP LLC/ZAYO CAP	6.0	2,000	1,987	245,413	2023/4/1
合	計				112,746,130	

* 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。

高利回り社債オープン マザーファンド

第10期(2014年7月7日決算)
(計算期間：2013年7月6日～2014年7月7日)

《運用報告書》

受益者のみなさまへ

高利回り社債オープン マザーファンドの第10期の運用状況をご報告申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

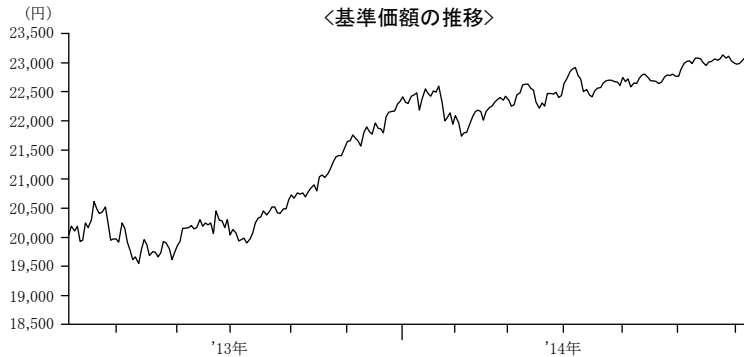
運用方針	主として米国ドル建ての高利回り事業債（ハイ・イールド・ボンド）に投資し、中長期的に、高水準のインカムゲインの確保に加え、キャピタルゲインの獲得を目指します。 ハイ・イールド・ボンドへの投資にあたっては、投資対象の徹底したクレジット分析を行うことにより、信用リスクのコントロールを行います。 外貨建て資産については、原則として、為替ヘッジを行いません。
主な投資対象	米国ドル建ての高利回り事業債（ハイ・イールド・ボンド）を主要投資対象とします。 なお、米国ドル建て以外のハイ・イールド・ボンドに投資する場合があります。
主な投資制限	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。 株式への投資は優先証券のうち株券等の性質を有するものまたは転換社債を転換したもの等に限りに、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の30%以内とします。

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1
<http://www.nomura-am.co.jp/>

◎基準価額の推移

基準価額は当作成期初の20,037円から当作成期末には23,191円となりました。

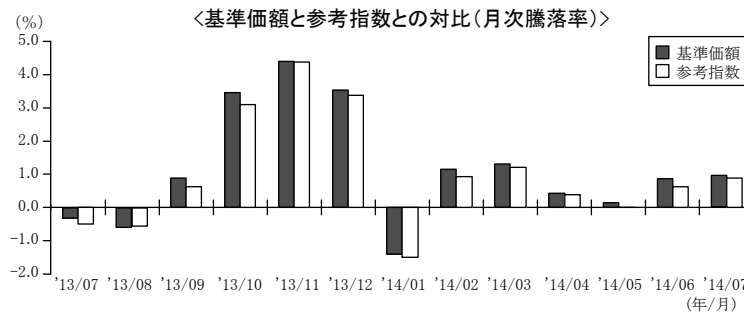


◎基準価額の主な変動要因

- ハイ・イールド債券からの高い利息収入
- 米国の政府機関の一部閉鎖が決定されるなど投資家心理の悪化にさらされる場面もあったが、議会が暫定予算の編成に合意し、一時的な債務上限引き上げについても容認したことを背景としたハイ・イールド債券の価格上昇
- FRB(米連邦準備制度理事会)議長による議会証言を受け緩和的な金融政策が長期化するとの見方が強まったことなどを背景としたハイ・イールド債券の価格上昇
- 当作成期を通して円安・ドル高に推移した為替相場

◎基準価額と参考指数との差異とその要因

参考指数の騰落率が+13.6%となったのに対し、基準価額の騰落率は+15.7%となりました。主な差異の要因は、相対的にパフォーマンスが高かったCCC格以下の銘柄を参考指数よりも高めにしていたことや、保有していた一部の銘柄のパフォーマンスが堅調であったことが、プラスに作用したことなどです。



※'13年7月は期初から月末まで、'14年7月は月初から期末までの期間で計算。

*参考指数 (=BofA・メリルリンチ・USハイ・イールド・キャッシュ・ベイ・コンストレインド・インデックス (円換算ベース)) は、BofA Merrill Lynch US High Yield, Cash Pay, 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米ドル為替レート (対顧客電信売買相場仲値) で円換算しております。

(出所)ブルームバーグ、(出所および許可)バンクオブアメリカ・メリルリンチ

◎運用経過

○資産別組入比率

ハイ・イールド債券の組み入れについては、当作成期間を通じて高位を維持しました。

○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、BB格、B格、CCC格などに幅広く組み入れを行い、BBB格以上、BB格、B格、CCC格、CC格、C格以下及び無格付けの組入比率は、当作成期末には0.7%、16.3%、40.3%、37.3%、0.6%、1.2%としました。

◎今後の運用方針

- 当ファンドは、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ってまいります。また、銘柄選択では多くの発行体に投資を行う分散投資を基本とし、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、高水準のインカムゲイン(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、米国経済の緩やかな成長を背景に当面は堅調に推移すると考えられます。ハイ・イールド債券のファンダメンタルズ(基礎的諸条件)が健全であることや、低水準の債務償還額などから、デフォルト(債務不履行)率は今後も低水準で推移すると考えられます。FRB(米連邦準備制度理事会)はゼロ金利政策を維持しており、引き続き緩和姿勢を継続すると予想されます。今後米国経済の成長に伴う金利上昇(債券価格は下落)局面においても、当ファンドが組み入れているハイ・イールド債は、デュレーション(金利感応度)の短さなどから、その他債券資産より投資成果が大きくなる可能性が高いと考えられます。このような環境下、業種別配分、格付別配分については状況に基づき慎重に判断します。相対的に割安と判断する銘柄を積極的にポートフォリオに組み入れていきます。
- 個別銘柄の選択に際しては、より一層慎重な対応を行なってまいります。今後も引き続きキャッシュフロー(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う方針です。
- 外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

◎ 1万口当たりの費用の明細

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	0円 (0)
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式)	0 (0)
(c) 保 管 費 用 等	9
合 計	9

* (a) 売買委託手数料、(b) 有価証券取引税、(c) 保管費用等は、期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。
* 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

◎ 期中の売買及び取引の状況 (自 2013年7月6日 至 2014年7月7日)

(1) 株式

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	百株		百株	
ア メ リ カ	969 (45,548)	千米ドル 3,227 (771)	395	千米ドル 1,659

* 金額は受け渡し代金。
* 単位未満は切り捨て。
* ()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。

(2) 新株予約権証券

	買 付		売 付	
	証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	証券		証券	
ア メ リ カ	— (436,101)	千米ドル — (47)	436,101	千米ドル 84

* 金額は受け渡し代金。
* 金額の単位未満は切り捨て。
* ()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。

(3) 公社債

外 国	買 付 額	売 付 額
ア メ リ カ	千米ドル	千米ドル
社債券 (投資法人債券を含む)	830,230 (2,288)	668,149 (113,179)

* 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。

◎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	490,499千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,037,473千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.47

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

◎組入資産の明細

(1)外国株式

上場、登録株式

銘 柄	期 首		当 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		
ALLY FINANCIAL 8.50% Series A	356	356	981	100,340	消費者金融	
ALLY FINANCIAL 7.0000% SERIES 144A	71	73	7,442	760,640	消費者金融	
CATALYST PAPER CORP	168	168	44	4,524	紙製品・林産品	
CITIGROUP INC 6.8750% Series K	—	457	1,244	127,150	商業銀行	
DIRECTBUY HOLDINGS INC	48	48	—	—	機械	
EME REORGANIZATION TRUST	—	45,383	728	74,442	各種金融サービス	
GMAC CAP TR I 8.125% 2/15/40 Series2	270	270	738	75,443	各種金融サービス	
GEN FIN CORP 8.1250% 7/31/21 Series	—	283	717	73,330	商社・流通業	
GEOKINETICS INC	5	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
REGIONS FINL (RF) 6.3750% Series A	160	160	400	40,958	商業銀行	
合 計	株 数 ・ 金 額	1,080	47,202	12,297	1,256,831	
	銘 柄 数 < 比 率 >	7	9	—	<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。

* 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する株式評価額の比率。

* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。

* 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。

(2)外国(外貨建)公社債

区 分	期 首					当 期 末							
	組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率			額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
			5年以上	2年以上	2年未満		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	%	%	%	%	%	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
95.5	93.8	72.2	21.8	1.5	1,341,260	1,404,149	143,504,046	95.5	94.8	68.1	25.6	1.9	
合 計	95.5	93.8	72.2	21.8	1.5	1,341,260	1,404,149	143,504,046	95.5	94.8	68.1	25.6	1.9

* 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、価格情報会社等よりデータを入手しています。

* スタンダード・アンド・プアーズ、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。

外国(外貨建)公社債銘柄別

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				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)	24 HOUR HOLDINGS III LLC	8.0	1,800	1,800	183,960	2022/6/1
	99 CENTS ONLY STORES	11.0	2,525	2,809	287,086	2019/12/15
	AAF HLG/FIN	6.0	1,325	1,364	139,477	2019/7/1
	ACCURIDE CORP	9.5	1,125	1,186	121,258	2018/8/1
	ACE CASH EXPRESS INC	11.0	750	607	62,086	2019/2/1
	ACTIVISTION BLIZZARD	5.625	300	325	33,266	2021/9/15
	ACTUANT CORPORATION	5.625	450	475	48,634	2022/6/15
	ADVANCED MICRO DEVICES	6.75	2,650	2,838	290,126	2019/3/1
	ADVANCED MICRO DEVICES	7.0	2,950	3,023	309,027	2024/7/1
	AES CORPORATION	8.0	423	492	50,363	2017/10/15
	AES CORPORATION	4.875	450	445	45,530	2023/5/15
	AES CORPORATION	5.5	1,350	1,383	141,419	2024/3/15
	AFFINIA GROUP INC	7.75	2,225	2,352	240,470	2021/5/1
	AFFINION GROUP HOLDINGS	13.75	1,525	1,525	155,855	2018/9/15
	AFFINION INVESTMENTS LLC	13.5	841	875	89,441	2018/8/15
	AINSWORTH LUMBER LTD	7.5	2,047	2,164	221,232	2017/12/15
	AIR CANADA	8.75	1,175	1,316	134,495	2020/4/1
	AIR CANADA	7.75	3,625	3,860	394,555	2021/4/15
	AIR CANADA 2013-1B PTC	5.375	192	199	20,342	2022/11/15
	AIR CANADA 2013-1C PTC	6.625	200	210	21,513	2018/5/15
	AIR LEASE CORP	4.75	800	861	88,054	2020/3/1
	AIRCASTLE LTD	4.625	650	670	68,557	2018/12/15
	AIRCASTLE LTD	6.25	950	1,041	106,455	2019/12/1
	AIRCASTLE LTD	5.125	1,025	1,061	108,440	2021/3/15
	AK STEEL CORP	8.375	2,700	2,868	293,186	2022/4/1
	ALBEA BEAUTY HOLDINGS SA	8.375	875	953	97,473	2019/11/1
	ALCATEL-LUCENT USA INC	4.625	2,025	2,106	215,233	2017/7/1
	ALCATEL-LUCENT USA INC	6.75	1,600	1,708	174,557	2020/11/15
	ALERE INC	7.25	450	490	50,129	2018/7/1
	ALERE INC	6.5	1,700	1,806	184,598	2020/6/15
	ALERIS INTERNATIONAL INC	—	650	—	—	2016/12/15
	ALERIS INTL INC	7.625	625	652	66,669	2018/2/15
	ALERIS INTL INC	7.875	725	755	77,244	2020/11/1
	ALGECO SCOTSMAN GLOB FIN	10.75	1,950	2,032	207,759	2019/10/15
	ALGOMA ACQUISITION CORP	9.875	200	132	13,490	2015/6/15
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES	5.875	400	436	44,577	2023/8/15
	ALLEGIANTE TRAVEL CO	5.5	600	613	62,699	2019/7/15
	ALLEGION US HOLDING CO	5.75	675	712	72,779	2021/10/1
	ALLEN SYSTEMS GROUP INC	—	2,700	1,417	144,868	2016/11/15
	ALLIANT TECHSYSTEMS INC	5.25	1,100	1,138	116,354	2021/10/1
	ALLY FINANCIAL	8.0	1,875	2,282	233,303	2020/3/15
	ALPHA NATURAL RESOURCES	9.75	325	295	30,225	2018/4/15
	ALPHA NATURAL RESOURCES	6.0	500	366	37,415	2019/6/1
	ALPHA NATURAL RESOURCES	7.5	675	649	66,398	2020/8/1
	ALTA MESA HLDGS/FINANC S	9.625	1,875	1,973	201,685	2018/10/15
	ALTICE FINANCING SA	7.875	325	356	36,411	2019/12/15
	ALTICE FINCO SA	9.875	325	375	38,400	2020/12/15
	ALTICE FINCO SA	8.125	200	221	22,611	2024/1/15
	ALTICE SA	7.75	2,200	2,359	241,140	2022/5/15
	AMC ENTERTAINMENT INC	5.875	825	864	88,319	2022/2/15
	AMC NETWORKS INC	4.75	1,575	1,586	162,172	2022/12/15
	AMERICAN ACHIEVEMENT COR	10.875	3,075	3,174	324,478	2016/4/15
	AMERICAN AXLE & MFG INC	6.25	3,125	3,367	344,126	2021/3/15

種 類	銘 柄 名	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	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	AMERICAN CAPITAL LTD	6.5	1,475	1,578	161,297	2018/9/15
	AMERICAN GILSONITE CO	11.5	500	542	55,443	2017/9/1
	AMERICAN GREETINGS	7.375	800	852	87,074	2021/12/1
	AMKOR TECHNOLOGIES INC	6.625	725	775	79,281	2021/6/1
	AMSTED INDUSTRIES	5.0	500	501	51,291	2022/3/15
	AMSURG CORP	5.625	300	308	31,503	2020/11/30
	ANCESTRY.COM INC	9.625	4,300	4,461	455,939	2018/10/15
	ANCESTRY.COM INC ACOM	11.0	3,200	3,776	385,907	2020/12/15
	ANTERO RESOURCES CORP	5.375	1,750	1,817	185,780	2021/11/1
	ANTERO RESOURCES FINANCE	5.125	750	769	78,662	2022/12/1
	APERAM	7.375	400	413	42,259	2016/4/1
	APERAM	7.75	175	187	19,114	2018/4/1
	APPROACH RESOURCES INC	7.0	950	995	101,701	2021/6/15
	APPVION INC	9.0	1,225	1,223	125,038	2020/6/1
	APX GROUP INC	6.375	600	621	63,466	2019/12/1
	APX GROUP INC	8.75	3,600	3,690	377,118	2020/12/1
	APX GROUP INC	8.75	400	408	41,697	2020/12/1
	ARAMARK CORP	5.75	1,275	1,351	138,123	2020/3/15
	ARCELORMITTAL	6.0	1,425	1,545	157,909	2021/3/1
	ARCELORMITTAL	7.5	2,117	2,325	237,662	2039/10/15
	ARCH COAL INC	7.0	1,575	1,200	122,735	2019/6/15
	ARCH COAL INC	9.875	1,800	1,530	156,366	2019/6/15
	ARD FINANCE SA	11.125	4,565	4,832	493,872	2018/6/1
	ARDAGH FINANCE HOLDINGS	8.625	4,000	4,150	424,130	2019/6/15
	ARES CAPITAL CORP	4.875	1,025	1,087	111,147	2018/11/30
	ARMOURED AUTOGROUP	9.25	2,475	2,598	265,592	2018/11/1
	ARTESYN ESCROW INC	9.75	2,600	2,580	263,727	2020/10/15
	ASBURY AUTOMOTIVE GROUP	8.375	1,075	1,194	122,087	2020/11/15
	ASHTREAD CAPITAL INC	6.5	2,050	2,249	229,937	2022/7/15
	ASHTON WOODS USA/FINANCE	6.875	3,975	3,984	407,260	2021/2/15
	ASSOC MAT LLC/AMH NEW FI	9.125	575	597	61,042	2017/11/1
	ATHLON HLDS LP / FIN COR	6.0	1,800	1,867	190,858	2022/5/1
	AUDATEX NORTH AMERICA IN	6.0	1,725	1,854	189,517	2021/6/15
	AUDATEX NORTH AMERICA IN	6.125	975	1,050	107,367	2023/11/1
	AURICO GOLD INC	7.75	675	676	69,157	2020/4/1
	AUS FINANCE PTY LTD	6.875	450	421	43,115	2019/11/1
	AV HOMES INC	8.5	1,450	1,477	150,968	2019/7/1
	AVAYA INC	10.5	4,725	4,382	447,885	2021/3/1
	AVIS BUDGET CAR/FINANCE	4.875	725	760	77,707	2017/11/15
	AVIS BUDGET CAR/FINANCE	5.125	1,925	1,944	198,702	2022/6/1
	AVIS BUDGET CAR/FINANCE	5.5	350	357	36,574	2023/4/1
	AVIV HEALTHCARE PROPERTI	7.75	275	294	30,142	2019/2/15
	AVIV HLTH PROP/AVIV HLTH	6.0	950	1,011	103,400	2021/10/15
B-CORP MERGER SUB INC	8.25	775	798	81,581	2019/6/1	
BAKER & TAYLOR ACQUISITI	15.0	1,052	999	102,138	2017/4/1	
BALL CORP	5.0	3,000	3,099	316,717	2022/3/15	
BANK OF AMERICA CORP	5.2	3,375	3,250	332,186	2049/12/29	
BANKRATE INC	6.125	950	1,009	103,158	2018/8/15	
BARCLAYS BANK PLC	7.625	3,650	4,186	427,854	2022/11/21	
BARCLAYS BANK PLC	7.75	3,025	3,387	346,151	2023/4/10	
BARCLAYS PLC	8.25	3,075	3,300	337,284	2049/12/29	
BC LUXCO 1 SA	7.375	150	155	15,889	2020/1/29	
BC MOUNTAIN LLC/BC MTN	7.0	400	389	39,755	2021/2/1	
BEAZER HOMES USA	8.125	1,000	1,107	113,186	2016/6/15	

種 類	銘 柄 名	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	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	BEAZER HOMES USA	5.75	950	957	97,818	2019/6/15
	BEAZER HOMES USA	7.25	1,675	1,746	178,460	2023/2/1
	BEV PACK HLDS LU/ISSUER	5.625	700	721	73,686	2016/12/15
	BEV PACK HLDS LU/ISSUER	6.0	2,425	2,491	254,650	2017/6/15
	BI-LO LLC/BI-LO FIN CORP	8.625	4,625	4,717	482,128	2018/9/15
	BIOSCRIP INC	8.875	1,300	1,360	139,004	2021/2/15
	BLOCK COMMUNICATIONS INC	7.25	1,075	1,150	117,555	2020/2/1
	BLUELINE RENTAL FINANCE	7.0	950	1,017	104,019	2019/2/1
	BMC SOFTWARE FINANCE INC	8.125	4,500	4,651	475,421	2021/7/15
	BOE INTERMEDIATE HLDNG C	9.0	3,207	3,365	343,956	2017/11/1
	BOE MERGER CORP	9.5	2,525	2,663	272,248	2017/11/1
	BOISE CASCADE LLC/FIN	6.375	775	835	85,343	2020/11/1
	BOMBARDIER INC	5.75	375	388	39,666	2022/3/15
	BOMBARDIER INC	6.0	975	1,010	103,257	2022/10/15
	BOXER PARENT CO INC	9.0	2,050	2,009	205,319	2019/10/15
	BOYD ACQUISITION SUB/FIN	8.375	2,500	2,678	273,704	2018/2/15
	BRAND ENERGY & INFRASTRU	8.5	2,250	2,401	245,471	2021/12/1
	BROCADE COMMUNICATIONS	4.625	825	804	82,207	2023/1/15
	BROOKFIELD RESIDENTIAL	6.5	950	1,009	103,158	2020/12/15
	BUFFALO THUNDER DEV AUTH	-	1,800	747	76,343	2014/12/15
	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	7.625	2,325	2,493	254,842	2021/6/1
	BUILDING MATERIALS CORP	7.0	625	665	68,026	2020/2/15
	BUILDING MATERIALS HOLDI	9.0	4,625	5,027	513,797	2018/9/15
	BURLINGTON HLDG INC/FIN	9.0	200	205	21,002	2018/2/15
	CABLEVISION SYSTEMS CORP	8.625	2,100	2,449	250,300	2017/9/15
	CAESARS ENTERTAINMENT OP	10.0	1,500	576	58,876	2018/12/15
	CAESARS ENTERTAINMENT OP	9.0	3,000	2,482	253,711	2020/2/15
	CAESARS OPERATING ESCROW	8.5	650	550	56,299	2020/2/15
	CALFRAC HOLDINGS LP	7.5	375	403	41,199	2020/12/1
	CALPINE CORP	5.875	1,925	2,045	209,030	2024/1/15
	CAPSUGEL SA	7.0	450	464	47,455	2019/5/15
	CARLSON TRAVEL HOLDINGS	7.5	2,000	2,057	210,276	2019/8/15
	CARMIKE CINEMAS INC	7.375	975	1,065	108,862	2019/5/15
	CASE NEW HOLLAND INC	7.875	1,425	1,663	170,028	2017/12/1
	CASTLE (AM) & CO	12.75	425	470	48,049	2016/12/15
	CATALYST PAPER CORP	11.0	292	264	27,011	2017/10/30
	CATAMARAN CORP	4.75	1,400	1,421	145,226	2021/3/15
	CB RICHARD ELLIS SERVICE	6.625	100	106	10,897	2020/10/15
	CBC AMMO LLC/CBC FINCO	7.25	925	951	97,229	2021/11/15
	CBS OUT AMER CAP LLC/COR	5.25	850	873	89,258	2022/2/15
	CBS OUT AMER CAP LLC/COR	5.625	850	879	89,910	2024/2/15
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	8.125	625	678	69,384	2020/4/30
	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	6.5	450	480	49,151	2021/4/30
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	5.25	2,000	2,040	208,488	2022/9/30	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	5.125	4,850	4,886	499,387	2023/2/15	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	5.75	5,650	5,883	601,248	2023/9/1	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	5.75	1,025	1,053	107,635	2024/1/15	
CEC ENTERTAINMENT INC	8.0	1,475	1,535	156,963	2022/2/15	
CEMEX FINANCE LLC	9.375	875	1,032	105,566	2022/10/12	
CEMEX FINANCE LLC	6.0	1,000	1,045	106,824	2024/4/1	
CENTENE CORP	5.75	500	545	55,699	2017/6/1	
CENTENE CORP	4.75	175	178	18,220	2022/5/15	
CENTRAL GARDEN & PET CO	8.25	1,000	1,043	106,671	2018/3/1	
CENTURY INTERMEDIATE HLD	9.75	1,525	1,635	167,154	2019/2/15	

種 類	銘 柄 名	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	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	CENTURYLINK INC	5.625	650	688	70,375	2020/4/1
	CENTURYLINK INC	6.75	1,225	1,348	137,825	2023/12/1
	CENTURYLINK INC	7.6	7,650	7,662	783,151	2039/9/15
	CENVEO CORP	8.875	250	262	26,833	2018/2/1
	CENVEO CORP	6.0	1,000	997	101,944	2019/8/1
	CENVEO CORP	8.5	1,950	1,937	198,044	2022/9/15
	CEQUEL COM ESCRW 1/CAP C	6.375	3,475	3,718	380,005	2020/9/15
	CEQUEL COM HLDG 1/CAP CP	5.125	5,075	5,081	519,313	2021/12/15
	CERIDIAN CORP	11.0	950	1,102	112,624	2021/3/15
	CERIDIAN LLC/COMDATA INC	8.125	2,775	2,816	287,859	2017/11/15
	CGG VERITAS	6.5	450	448	45,854	2021/6/1
	CHAPARRAL ENERGY INC	9.875	1,000	1,130	115,486	2020/10/1
	CHAPARRAL ENERGY INC	7.625	475	513	52,428	2022/11/15
	CHC HELICOPTER SA	9.25	2,362	2,592	264,988	2020/10/15
	CHC HELICOPTER SA	9.375	1,725	1,854	189,517	2021/6/1
	CHECKERS DRIVE-IN RESTAU	11.0	775	871	89,105	2017/12/1
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	5.375	1,375	1,471	150,361	2021/6/15
	CHESAPEAKE OIL OP/FIN	6.625	650	698	71,379	2019/11/15
	CHESAPEAKE OILFIELD OP	6.5	1,000	1,028	105,138	2022/7/15
	CHINOS INTERMED HLDGS A	7.75	2,400	2,406	245,893	2019/5/1
	CHOICE HOTELS INTL INC	5.75	1,700	1,833	187,336	2022/7/1
	CHRYSLER GP/CG CO-ISSUER	8.0	7,038	7,685	785,500	2019/6/15
	CHRYSLER GP/CG CO-ISSUER	8.25	2,750	3,117	318,640	2021/6/15
	CHS/COMMUNITY HEALTH	6.875	4,250	4,526	462,582	2022/2/1
	CINEMARK USA INC	5.125	700	722	73,865	2022/12/15
	CITIGROUP INC	5.35	4,050	3,893	397,870	2049/5/29
	CITIGROUP INC	5.95	300	303	31,059	2049/12/29
	CITIGROUP INC	5.9	2,025	2,047	209,266	2049/12/29
	CLAIRE'S STORES INC	8.875	1,275	1,115	114,016	2019/3/15
	CLAYTON WILLIAMS ENERGY	7.75	375	400	40,959	2019/4/1
	CLEAR CHANNEL COM	10.0	400	390	39,858	2018/1/15
	CLEAR CHANNEL COMMUNICAT	10.75	825	831	84,947	2016/8/1
	CLEAR CHANNEL COMMUNICAT	11.0	1,560	1,572	160,674	2016/8/1
	CLEAR CHANNEL COMMUNICAT	9.0	3,550	3,794	387,753	2019/12/15
	CLEAR CHANNEL COMMUNICAT	12.0	1,500	1,558	159,240	2021/2/1
	CLEAR CHANNEL COMMUNICAT	11.25	975	1,106	113,097	2021/3/1
	CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	7.625	1,675	1,809	184,879	2020/3/15
	CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	6.5	725	775	79,281	2022/11/15
	CLEARWIRE COMM/FINANCE	14.75	300	393	40,164	2016/12/1
	CLEAVER-BROOKS INC	8.75	4,625	5,166	528,063	2019/12/15
	CLOUD PEAK ENRGY RES/FIN	6.375	375	392	40,145	2024/3/15
	CMA CGM	8.5	450	466	47,668	2017/4/15
	CNG HOLDINGS INC	9.375	1,225	1,029	105,163	2020/5/15
COEUR D'ALENE MINES CORP	7.875	1,125	1,136	116,124	2021/2/1	
COGENT COMM FINANCE INC	5.625	2,500	2,487	254,222	2021/4/15	
COGENT COMMUNICATIONS GR	8.375	775	830	84,848	2018/2/15	
COLT DEFENSE/FINANCE	8.75	1,875	1,546	158,090	2017/11/15	
COMMERCIAL METALS CO	4.875	1,250	1,231	125,833	2023/5/15	
COMMERZBANK AG	8.125	500	605	61,835	2023/9/19	
COMMSCOPE HOLDINGS INC	6.625	2,975	3,198	326,848	2020/6/1	
COMMSCOPE INC	5.0	1,925	1,977	202,145	2021/6/15	
COMMSCOPE INC	5.5	1,925	1,982	202,637	2024/6/15	
COMMUNITY CHOICE FINANCI	10.75	1,275	1,096	112,062	2019/5/1	
COMPASS INVESTORS INC	7.75	4,625	4,763	486,855	2021/1/15	

種 類	銘 柄 名	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	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	COMPILER FINANCE SUB INC	7.0	1,350	1,377	140,729	2021/5/1
	COMSTOCK RESOURCES INC	7.75	375	399	40,816	2019/4/1
	CONCHO RESOURCES INC	6.5	975	1,072	109,609	2022/1/15
	CONN'S INC	7.25	975	981	100,267	2022/7/15
	CONS CNT CO/CONS CNT CAP	10.125	2,975	3,004	307,085	2020/7/15
	CONSOL ENERGY INC	6.375	375	401	41,007	2021/3/1
	CONSOL ENERGY INC	5.875	1,430	1,505	153,818	2022/4/15
	CONSOLIDATEC COMM FIN CO	10.875	1,225	1,434	146,634	2020/6/1
	CONSTELLATION ENTERPRISE	10.625	700	647	66,174	2016/2/1
	CONTINENTAL AIRLINES INC	6.75	1,450	1,466	149,857	2015/9/15
	CONTINENTAL RESOURCES	5.0	555	604	61,830	2022/9/15
	CONTL AIRLINES 2012-2 B	5.5	118	124	12,697	2020/10/29
	CONTL AIRLINES 2012-3 C	6.125	2,275	2,434	248,780	2018/4/29
	CONTOURGLOBAL POWER HLDD	7.125	200	199	20,388	2019/6/1
	COVANTA HOLDING CORP	5.875	725	755	77,244	2024/3/1
	CPG MERGER SUB LLC	8.0	2,350	2,485	253,979	2021/10/1
	CPI INTERNATIONAL ACQ	8.0	275	289	29,580	2018/2/15
	CREDIT AGRICOLE SA	7.875	200	220	22,502	2049/1/29
	CREDIT SUISSE GROUP AG	6.25	2,125	2,159	220,682	2049/12/29
	CRESCENT RESOURCES LLC	10.25	1,325	1,487	152,003	2017/8/15
	CRESTWOOD MIDSTREAM PART	6.0	500	528	54,038	2020/12/15
	CRESTWOOD MIDSTREAM PART	6.125	950	1,004	102,672	2022/3/1
	CROSSTEX ENERGY LP/CROSS	7.125	452	526	53,787	2022/6/1
	CROWN CASTLE INTL CORP	5.25	2,330	2,434	248,841	2023/1/15
	CUMULUS MEDIA INC	7.75	150	158	16,192	2019/5/1
	CVR REF LLC/COFF FIN INC	6.5	750	796	81,440	2022/11/1
	CYRUSONE LP/CYRUSONE FIN	6.375	625	678	69,304	2022/11/15
	D. R. HORTON INC	5.75	1,950	2,091	213,738	2023/8/15
	DANA HOLDING CORP	5.375	2,600	2,730	279,006	2021/9/15
	DANA HOLDING CORP	6.0	2,925	3,115	318,365	2023/9/15
	DAVE & BUSTER'S INC	11.0	750	795	81,249	2018/6/1
	DEAN FOODS CO	7.0	1,240	1,365	139,559	2016/6/1
	DELUXE CORP	7.0	425	456	46,692	2019/3/15
	DENBURY RESOURCES INC	5.5	550	564	57,685	2022/5/1
	DENBURY RESOURCES INC	4.625	1,775	1,726	176,416	2023/7/15
	DENVER PARENT CORP	12.25	2,300	2,242	229,183	2018/8/15
	DIAMOND FOODS INC	7.0	800	840	85,848	2019/3/15
	DIGICEL GROUP LTD	8.25	775	801	81,882	2017/9/1
	DIGICEL GROUP LTD	8.25	3,150	3,457	353,318	2020/9/30
	DIGICEL GROUP LTD	7.125	6,200	6,478	662,071	2022/4/1
	DIGICEL LIMITED	7.0	200	213	21,768	2020/2/15
	DIGICEL LIMITED	6.0	2,275	2,358	241,035	2021/4/15
	DIRECTBUY HOLDINGS INC	12.0	522	138	14,142	2019/10/31
DISH DBS CORP	4.625	50	53	5,442	2017/7/15	
DISH DBS CORP	5.125	2,300	2,432	248,575	2020/5/1	
DISH DBS CORP	5.0	1,100	1,122	114,668	2023/3/15	
DRIVETIME AUTO GP & ACCE	8.0	1,950	2,010	205,517	2021/6/1	
DUFREY FINANCE SCA	5.5	475	494	50,531	2020/10/15	
DUPONT FABROSS TECH LP	5.875	1,200	1,263	129,078	2021/9/15	
DYNACAST INTL LLC/FIN IN	9.25	1,100	1,221	124,786	2019/7/15	
DYNEGY INC	5.875	1,675	1,687	172,468	2023/6/1	
EAGLE MIDCO INC	9.0	850	881	90,127	2018/6/15	
EARTHLINK INC	8.875	1,525	1,536	157,023	2019/5/15	
EILEME 2 AB	11.625	675	806	82,415	2020/1/31	

種 類	銘 柄 名	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	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	EMECO PTY LTD	9.875	800	824	84,212	2019/3/15
	ENDO FINANCE LLC	5.75	875	898	91,861	2022/1/15
	ENERGY FUTURE/EFIH FINAN	—	690	835	85,410	2018/12/1
	ENERGY FUTURE/EFIH FINAN	—	1,550	1,929	197,220	2022/3/1
	ENERGY TRANSFER EQUITY	5.875	725	761	77,799	2024/1/15
	ENERGY XXI GULF COAST IN	7.5	1,475	1,596	163,181	2021/12/15
	ENERGY XXI GULF COAST IN	6.875	200	204	20,899	2024/3/15
	ENTEGRIS INC	6.0	475	491	50,244	2022/4/1
	EQUINIX INC	5.375	6,550	6,762	691,165	2023/4/1
	ERICKSON INC	8.25	1,554	1,604	163,980	2020/5/1
	ESSAR STEEL ALGOMA INC	9.375	900	902	92,209	2015/3/15
	ESSAR STEEL MINNESOTA	11.5	375	379	38,756	2020/5/15
	EV ENERGY PARTNERS/FINAN	8.0	275	290	29,650	2019/4/15
	EXCO RESOURCES INC	8.5	1,775	1,918	196,029	2022/4/15
	EXOPACK HOLDINGS SA	7.875	1,000	1,075	109,865	2019/11/1
	EXOPACK HOLDNG CORP	10.0	1,300	1,400	143,156	2018/6/1
	EXPRESS LLC	8.75	375	394	40,337	2018/3/1
	FERRELLGAS LP/FERRELLGAS	6.75	2,875	3,033	309,985	2022/1/15
	FERRELLGAS PARTNERS LP	8.625	520	557	56,996	2020/6/15
	FGI OPERATING CO LLC/FIN	7.875	600	645	65,919	2020/5/1
	FIRST CASH FINANCIAL SER	6.75	815	867	88,707	2021/4/1
	FIRST DATA CORPORATION	7.375	1,700	1,819	185,901	2019/6/15
	FIRST DATA CORPORATION	6.75	275	297	30,423	2020/11/1
	FIRST DATA CORPORATION	10.625	3,075	3,582	366,118	2021/6/15
	FIRST DATA CORPORATION	11.75	8,655	10,266	1,049,286	2021/8/15
	FIRST DATA HOLDINGS INC	14.5	6,588	7,354	751,603	2019/9/24
	FIRST QUANTUM MINERALS L	7.25	200	209	21,359	2022/5/15
	FIRST WIND CAPITAL LLC	10.25	475	509	52,064	2018/6/1
	FLASH DUTCH 2 BV & US CO	7.375	2,150	2,351	240,329	2021/5/1
	FLEXI-VAN LEASNG	7.875	1,550	1,681	171,874	2018/8/15
	FLORIDA EAST COAST HLDGS	6.75	725	768	78,540	2019/5/1
	FLORIDA EAST COAST HLDGS	9.75	375	398	40,720	2020/5/1
	FLY LEASING LTD	6.75	200	212	21,717	2020/12/15
	FMG RESOURCES AUG 2006	6.0	122	126	12,934	2017/4/1
	FORBES ENERGY SERVICES	9.0	1,825	1,907	194,908	2019/6/15
	FORD MOTOR COMPANY	9.215	350	466	47,656	2021/9/15
	FOREST LABORATORIES INC	5.0	1,500	1,643	167,940	2021/12/15
	FORESTAR USA REAL ESTATE	8.5	300	312	31,886	2022/6/1
	FREESCALE SEMICONDUCTOR	5.0	225	231	23,627	2021/5/15
	FREESCALE SEMICONDUCTOR	6.0	2,850	3,056	312,387	2022/1/15
	FRESENIUS MED CARE II	5.875	825	919	94,011	2022/1/31
	FRONTIER COMMUNICATIONS	7.625	175	187	19,204	2024/4/15
	GANNETT CO INC	5.125	1,450	1,508	154,117	2019/10/15
GANNETT CO INC	6.375	1,450	1,551	158,563	2023/10/15	
GARDA WORLD SECURITY COR	7.25	3,825	4,035	412,415	2021/11/15	
GARDA WORLD SECURITY COR	7.25	2,800	2,954	301,898	2021/11/15	
GATES GLOBAL LLC	6.0	4,650	4,673	477,606	2022/7/15	
GCI INC	8.625	300	318	32,576	2019/11/15	
GENCORP INC	7.125	2,225	2,436	248,997	2021/3/15	
GENERAL MOTORS CO	6.25	1,000	1,143	116,872	2043/10/2	
GENERAL MOTORS FINL CO	3.25	325	329	33,713	2018/5/15	
GENERAL MOTORS FINL CO	4.25	1,700	1,702	173,957	2023/5/15	
GENON ESCROW CORP	9.5	5,048	5,565	568,785	2018/10/15	
GENON ESCROW CORP	9.875	1,500	1,631	166,713	2020/10/15	

種 類	銘 柄 名	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	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	GEO GROUP INC/THE	5.875	975	1,028	105,125	2022/1/15
	GEORGIA GULF CORPORATION	4.875	2,525	2,521	257,732	2023/5/15
	GESTAMP FUND LUX SA	5.625	925	969	99,056	2020/5/31
	GIBALTAR STEEL CORP OF	6.25	450	470	48,059	2021/2/1
	GIBSON ENERGY INC	6.75	775	842	86,135	2021/7/15
	GLOBAL BRASS AND COPPER	9.5	1,600	1,832	187,230	2019/6/1
	GLOBAL PART/GLP FINANCE	6.25	700	706	72,165	2022/7/15
	GLP CAPITAL LP / FIN II	4.875	2,800	2,898	296,175	2020/11/1
	GMAC LLC	8.0	2,100	2,698	275,786	2031/11/1
	GOLDEN NUGGET ESCROW INC	8.5	2,300	2,423	247,694	2021/12/1
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	5.7	400	413	42,254	2049/12/29
	GRAFTECH INTERNATIONAL	6.375	675	699	71,442	2020/11/15
	GRATON ECONOMIC DEV AUTH	9.625	275	313	32,039	2019/9/1
	GRAY TELEVISION INC	7.5	4,025	4,367	446,320	2020/10/1
	GREAT LAKES DREDGE&DOCK	7.375	25	26	2,695	2019/2/1
	GREIF INC	7.75	875	1,010	103,285	2019/8/1
	GRIFFON CORPORATION	5.25	1,000	1,000	102,200	2022/3/1
	GUITAR CENTER INC	6.5	1,000	992	101,433	2019/4/15
	GUITAR CENTER INC	9.625	775	740	75,640	2020/4/15
	GULFPORT ENERGY CORP	7.75	1,075	1,169	119,478	2020/11/1
	GYMBOREE CORP	9.125	2,250	1,504	153,779	2018/12/1
	H&E EQUIPMENT SERVICES	7.0	975	1,082	110,605	2022/9/1
	HALCON RESOURCES CORP	9.75	950	1,045	106,799	2020/7/15
	HALCON RESOURCES CORP	8.875	5,425	5,842	597,057	2021/5/15
	HAPAG-LLOYD AG	9.75	150	161	16,537	2017/10/15
	HARBINGER GROUP INC	7.875	181	198	20,324	2019/7/15
	HARBINGER GROUP INC	7.75	2,130	2,199	224,760	2022/1/15
	HARLAND CLARKE HLDINGS	6.875	825	879	89,900	2020/3/1
	HARLAND CLARKE HOLDINGS	9.75	400	441	45,121	2018/8/1
	HARLAND ESCROW CORP	9.25	2,825	2,990	305,677	2021/3/1
	HARRAHS OPERATING CO INC	10.75	1,957	1,423	145,503	2016/2/1
	HAWAIIAN AIRLINES 13-1B	4.95	350	347	35,501	2022/1/15
	HAWKER BEECHCRAFT ACQ CO	-	125	-	-	2015/4/1
	HAWKER BEECHCRAFT ESCROW	-	200	-	-	2017/4/1
	HCA HOLDINGS INC	6.25	850	914	93,493	2021/2/15
	HCA HOLDINGS INC	7.75	8,405	9,224	942,742	2021/5/15
	HD SUPPLY INC	11.5	4,950	5,927	605,803	2020/7/15
	HEADWATERS INC	7.25	1,550	1,650	168,706	2019/1/15
	HEADWATERS INC	7.625	250	268	27,466	2019/4/1
	HEARTHSIDE GROUP HLDS/FI	6.5	1,450	1,460	149,301	2022/5/1
	HECLA MINING CO	6.875	2,750	2,743	280,347	2021/5/1
	HELLAS II	-	1,700	-	-	2015/1/15
	HERCULES OFFSHORE INC	10.25	1,000	1,102	112,675	2019/4/1
HERCULES OFFSHORE INC	8.75	1,475	1,559	159,412	2021/7/15	
HERCULES OFFSHORE INC	7.5	3,650	3,631	371,164	2021/10/1	
HERCULES OFFSHORE INC	6.75	2,600	2,466	252,101	2022/4/1	
HERTZ CORP	5.875	375	395	40,390	2020/10/15	
HEXION US FIN/NOVA SCOTI	9.0	8,275	8,481	866,847	2020/11/15	
HEXION US FINANCE CORP	6.625	2,575	2,742	280,270	2020/4/15	
HILAND PART LP/CORP	7.25	1,850	2,025	207,031	2020/10/1	
HILAND PART LP/CORP	5.5	550	562	57,474	2022/5/15	
HILCORP ENERGY I/HILCORP	7.625	500	548	56,082	2021/4/15	
HILLMAN GROUP INC	10.875	1,450	1,537	157,108	2018/6/1	
HILLMAN GROUP INC	6.375	1,500	1,505	153,874	2022/7/15	

種 類	銘 柄 名	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	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	HOCKEY MERGER SUB 2 INC	7.875	4,325	4,649	475,166	2021/10/1
	HUB HOLDINGS LLC/HUB HOL	8.125	1,800	1,824	186,489	2019/7/15
	HUNT COS INC	9.625	1,875	2,001	204,559	2021/3/1
	HUNTINGTON INGALLS INDUS	7.125	450	492	50,359	2021/3/15
	HUNTSMAN INTERNATIONAL L	4.875	1,200	1,246	127,392	2020/11/15
	IAC/INTERACTIVECORP	4.75	1,725	1,703	174,091	2022/12/15
	IAMGOLD CORP	6.75	1,150	1,089	111,359	2020/10/1
	ICAHN ENTERPRISES/FIN	4.875	1,725	1,781	182,024	2019/3/15
	ICAHN ENTERPRISES/FIN	6.0	900	968	98,993	2020/8/1
	ICON HEALTH & FITNESS	11.875	2,175	2,150	219,784	2016/10/15
	IFM US COLONIAL PIPELINE	6.45	250	266	27,189	2021/5/1
	IGATE CORP	4.75	1,425	1,460	149,275	2019/4/15
	IGLOO HOLDINGS CORP	8.25	5,250	5,368	548,622	2017/12/15
	ILFC E-CAPITAL TRUST I	5.02	500	492	50,333	2065/12/21
	ILLINOIS PWR GENERATING	7.0	550	550	56,210	2018/4/15
	IHS HEALTH INC	6.0	825	872	89,163	2020/11/1
	INC RESEARCH INC	11.5	1,500	1,702	173,995	2019/7/15
	INEOS GROUP HOLDINGS SA	6.125	1,426	1,481	151,384	2018/8/15
	INEOS GROUP HOLDINGS SA	5.875	200	206	21,070	2019/2/1
	INFOR SOFTWARE PARENT	7.125	1,850	1,896	193,796	2021/5/1
	INFOR US INC	9.375	1,000	1,113	113,825	2019/4/1
	INN OF THE MOUNTAIN GODS	9.25	1,627	1,623	165,930	2020/11/30
	INTELSAT LUXEMBOURG SA	6.75	1,575	1,675	171,226	2018/6/1
	INTELSAT LUXEMBOURG SA	7.75	400	425	43,486	2021/6/1
	INTELSAT LUXEMBOURG SA	8.125	5,850	6,325	646,446	2023/6/1
	INTERACTIVE DATA CORP	5.875	1,225	1,240	126,759	2019/4/15
	INTERGEN NV	7.0	2,750	2,846	290,886	2023/6/30
	INTERLINE BRANDS INC	10.0	1,150	1,236	126,344	2018/11/15
	INTL LEASE FINANCE CORP	5.875	1,125	1,238	126,616	2019/4/1
	INTL LEASE FINANCE CORP	8.25	1,575	1,945	198,791	2020/12/15
	INTL LEASE FINANCE CORP	8.625	725	910	93,081	2022/1/15
	INTREPID AVIATION GRP HL	6.875	1,375	1,454	148,605	2019/2/15
	INVENTIV HEALTH INC	9.0	1,050	1,128	115,358	2018/1/15
	INVENTIV HEALTH INC	11.0	675	648	66,225	2018/8/15
	INVENTIV HEALTH INC	11.0	1,475	1,412	144,338	2018/8/15
	IPAYMENT HOLDINGS INC	15.0	676	243	24,876	2018/11/15
	IPAYMENT INC	10.25	3,950	3,574	365,339	2018/5/15
	ISLE OF CAPRI CASINOS	8.875	2,150	2,375	242,801	2020/6/15
	ISLE OF CAPRI CASINOS	5.875	500	531	54,293	2021/3/15
	ITHACA ENERGY INC	8.125	1,800	1,833	187,409	2019/7/1
	JACK COOPER HOLDINGS COR	9.25	4,700	5,181	529,574	2020/6/1
	JAGUAR HOLDING CO I	9.375	1,875	1,931	197,373	2017/10/15
	JAGUAR HOLDING CO/MERGER	9.5	225	246	25,208	2019/12/1
	JAGUAR LAND ROVER PLC	8.125	2,750	3,117	318,640	2021/5/15
	JAMES RIVER ESCROW INC	-	475	59	6,068	2019/4/1
	JBS INVESTMENTS GMBH	7.75	800	858	87,749	2020/10/28
	JBS INVESTMENTS GMBH	7.25	2,400	2,493	254,814	2024/4/3
	JBS USA LLC/JBS USA FINA	8.25	1,150	1,253	128,107	2020/2/1
	JBS USA LLC/JBS USA FINA	7.25	2,000	2,157	220,445	2021/6/1
	JCH PARENT INC	10.5	2,025	2,025	206,955	2019/3/15
JEFFERIES FIN LLC / JFIN	6.875	305	312	31,950	2022/4/15	
JMC STEEL GROUP	8.25	550	563	57,615	2018/3/15	
JPMORGAN CHASE & CO	6.0	1,625	1,661	169,796	2049/12/29	
JPMORGAN CHASE & CO	6.125	3,450	3,546	362,451	2049/12/29	

種 類	銘 柄 名	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	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	JPMORGAN CHASE & CO	5.15	1,050	1,009	103,210	2049/12/31
	JURASSIC HOLDINGS III	6.875	2,600	2,658	271,698	2021/2/15
	K HOVNANIAN ENTERPRISES	11.875	375	419	42,828	2015/10/15
	K HOVNANIAN ENTERPRISES	7.0	625	641	65,511	2019/1/15
	K HOVNANIAN ENTERPRISES	7.5	972	1,046	106,912	2016/5/15
	K HOVNANIAN ENTERPRISES	6.25	1,700	1,782	182,209	2016/1/15
	KB HOME	9.1	475	562	57,525	2017/9/15
	KB HOME	4.75	475	477	48,787	2019/5/15
	KB HOME	7.0	1,350	1,474	150,732	2021/12/15
	KCG HOLDINGS INC	8.25	2,650	2,832	289,449	2018/6/15
	KEHE DISTRIBUTORS LLC/FI	7.625	1,550	1,692	172,963	2021/8/15
	KENAN ADVANTAGE GROUP	8.375	600	643	65,765	2018/12/15
	KENNEDY-WILSON INC	8.75	1,050	1,143	116,892	2019/4/1
	KENNEDY-WILSON INC	5.875	925	948	96,898	2024/4/1
	KINDER MORGAN INC/DELAWA	5.0	2,375	2,464	251,827	2021/2/15
	KINDRED HEALTHCARE INC	6.375	1,925	1,958	200,177	2022/4/15
	KINOVE GERMAN BONDCO GMB	9.625	325	351	35,872	2018/6/15
	KISSNER MILLING CO LTD	7.25	3,175	3,278	335,030	2019/6/1
	KODIAK OIL & GAS CORP	5.5	175	183	18,734	2021/1/15
	KODIAK OIL & GAS CORP	5.5	1,100	1,146	117,197	2022/2/1
	L BRANDS INC	5.625	2,375	2,596	265,326	2023/10/15
	LADDER CAP FIN LLC/CORP	7.375	1,350	1,468	150,042	2017/10/1
	LAMAR MEDIA CORP	5.0	75	75	7,760	2023/5/1
	LANDRY'S HOLDINGS II INC	10.25	4,425	4,712	481,630	2018/1/1
	LANDRY'S INC	9.375	3,800	4,199	429,137	2020/5/1
	LAREDO PETROLEUM INC	9.5	1,000	1,095	111,909	2019/2/15
	LBC TANK TERMINAL HLDING	6.875	575	608	62,143	2023/5/15
	LBG CAPITAL NO.1 PLC	8.0	80	88	9,065	2049/12/29
	LEAR CORP	8.125	350	378	38,721	2020/3/15
	LEAR CORP	5.375	1,375	1,412	144,389	2024/3/15
	LEE ENTERPRISES INC	9.5	675	721	73,727	2022/3/15
	LENDER PROCESS SERVICES	5.75	400	430	43,997	2023/4/15
	LENNAR CORP	12.25	950	1,211	123,789	2017/6/1
	LENNAR CORP	6.95	1,700	1,923	196,543	2018/6/1
	LENNAR CORP	4.75	2,125	2,125	217,175	2022/11/15
	LEVEL 3 COMMUNICATIONS	8.875	1,750	1,918	196,064	2019/6/1
	LEVEL 3 FINANCING INC	3.8229	1,375	1,402	143,335	2018/1/15
	LEVEL 3 FINANCING INC	8.125	3,275	3,586	366,501	2019/7/1
	LEVEL 3 FINANCING INC	6.125	2,450	2,624	268,230	2021/1/15
	LIFEPOINT HOSPITALS INC	5.5	1,450	1,524	155,796	2021/12/1
	LIMITED BRANDS INC	5.625	1,050	1,141	116,699	2022/2/15
	LIN TELEVISION CORP	8.375	750	785	80,290	2018/4/15
	LIN TELEVISION CORP	6.375	625	660	67,547	2021/1/15
LOCAL INSIGHT REGATTA	-	1,125	-	-	2017/12/1	
LOGO MERGER SUB CORP	8.375	3,300	3,514	359,181	2020/10/15	
LONESTAR RESOURCES AMERI	8.75	1,500	1,526	155,982	2019/4/15	
LOUISIANA PACIFIC CORP	7.5	725	800	81,782	2020/6/1	
LYNX I CORP	5.375	1,050	1,110	113,480	2021/4/15	
LYONDELLBASELL IND NV	5.0	2,500	2,789	285,048	2019/4/15	
MAGNUM HUNTER RESOURCES	9.75	3,418	3,802	388,618	2020/5/15	
MANITOWOC COMPANY INC	5.875	475	524	53,642	2022/10/15	
MARFRIG HOLDING EUROPE B	6.875	200	202	20,662	2019/6/24	
MARIPOSA BOR / MERG SUB	8.0	2,025	2,202	225,063	2021/10/15	
MARIPOSA BOR / MERG SUB	8.75	575	631	64,494	2021/10/15	

種 類	銘 柄 名	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	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	MARKWEST ENERGY PART/FIN	6.75	475	516	52,748	2020/11/1
	MARKWEST ENERGY PART/FIN	6.25	3	3	337	2022/6/15
	MARQUETTE TRANS CO/FINAN	10.875	825	874	89,394	2017/1/15
	MASONITE INTERNATIONAL C	8.25	225	246	25,179	2021/4/15
	MATTAMY GROUP CORP	6.5	1,100	1,133	115,792	2020/11/15
	MCCLATCHY CO	9.0	1,650	1,897	193,924	2022/12/15
	MDC HOLDINGS INC	6.0	3,400	3,233	330,453	2043/1/15
	MDC PARTNERS INC	6.75	850	901	92,082	2020/4/1
	MEDIACOM BRBND LLC/CORP	5.5	675	684	69,933	2021/4/15
	MEDIACOM BRBND LLC/CORP	6.375	850	898	91,865	2023/4/1
	MEDIACOM LLC/CAPTL CORP	9.125	1,150	1,210	123,700	2019/8/15
	MEG ENERGY CORP	6.375	575	618	63,172	2023/1/30
	MERISANT ESCROW	12.25	600	—	—	2014/5/15
	MERITAGE HOMES CORP	4.5	425	438	44,846	2018/3/1
	MERITAGE HOMES CORP	7.0	360	396	40,563	2022/4/1
	MERITOR INC	6.25	500	522	53,399	2024/2/15
	METHANEX CORP	6.0	200	210	21,516	2015/8/15
	METHANEX CORP	5.25	275	302	30,876	2022/3/1
	MGM RESORTS INTL	10.0	1,750	2,075	212,160	2016/11/1
	MGM RESORTS INTL	8.625	2,475	2,948	301,320	2019/2/1
	MGM RESORTS INTL	6.75	1,825	2,045	209,027	2020/10/1
	MGM RESORTS INTL	7.75	1,150	1,357	138,687	2022/3/15
	MICHAEL BAKER HLDINGS/FI	8.875	900	904	92,439	2019/4/15
	MICHAEL BAKER INTL INC	8.25	600	642	65,612	2018/10/15
	MICHAELS FINCO HLDG/INC	7.5	3,925	4,028	411,664	2018/8/1
	MIDSTATES PETRO INC/LLC	10.75	3,100	3,534	361,174	2020/10/1
	MIDSTATES PETRO INC/LLC	9.25	3,200	3,536	361,379	2021/6/1
	MIDWEST VANADIUM PTY LTD	12.25	150	66	6,745	2018/2/15
	MILACRON LLC/MCRON FIN	7.75	3,975	4,355	445,163	2021/2/15
	MILLAR WESTERN FOREST	8.5	625	670	68,505	2021/4/1
	MIRABELA NICKEL LTD	8.75	275	66	6,745	2018/4/15
	MISA INVESTMENTS LTD	8.625	300	307	31,464	2018/8/15
	MODULAR SPACE CORP	10.25	875	924	94,455	2019/1/31
	MOHEGAN TRIBAL GAMING	9.75	1,725	1,927	197,009	2021/9/1
	MONITRONICS INTERNATIONAL	9.125	1,275	1,370	140,077	2020/4/1
	MOOD MEDIA CORP	9.25	900	814	83,241	2020/10/15
	MPH ACQUISITION HOLDINGS	6.625	6,925	7,271	743,121	2022/4/1
	MPL 2 ACQUISITION CANCO	9.875	1,050	1,136	116,163	2018/8/15
	MPT OPER PARTNERSP/FINL	6.875	1,050	1,152	117,772	2021/5/1
	MPT OPER PARTNERSP/FINL	6.375	1,325	1,426	145,833	2022/2/15
	MRT MID PART/MRT MID FIN	7.25	1,650	1,744	178,326	2021/2/15
	MU FINANCE PLC	8.375	958	1,007	102,915	2017/2/1
	MURRAY ENERGY CORP	8.625	825	897	91,692	2021/6/15
MUSTANG MERGER CORP	8.5	2,525	2,764	282,570	2021/8/15	
NAI ENTERTAINMENT HLDING	5.0	525	546	55,801	2018/8/1	
NANA DEVELOPMENT CORP	9.5	775	757	77,422	2019/3/15	
NATIONAL CINEMEDIA LLC	7.875	850	928	94,905	2021/7/15	
NATIONAL CINEMEDIA LLC	6.0	1,100	1,157	118,322	2022/4/15	
NATIONSTAR MORT/CAP CORP	6.5	1,775	1,830	187,073	2018/8/1	
NATIONSTAR MORT/CAP CORP	9.625	400	447	45,683	2019/5/1	
NATIONSTAR MORT/CAP CORP	7.875	325	342	35,041	2020/10/1	
NATIONSTAR MORT/CAP CORP	6.5	5,225	5,231	534,662	2022/6/1	
NAVISTAR INTL CORP	8.25	2,825	2,962	302,789	2021/11/1	
NBTY INC	9.0	750	795	81,344	2018/10/1	

種 類	銘 柄 名	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	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	NCR ESCROW CORP	5.875	700	745	76,190	2021/12/15
	NCR ESCROW CORP	6.375	1,500	1,638	167,480	2023/12/15
	NEOVIA LOGISTICS INT HLD	10.0	2,425	2,534	258,987	2018/2/15
	NES RENTALS HOLDINGS	7.875	3,600	3,861	394,594	2018/5/1
	NEUSTAR INC	4.5	75	65	6,668	2023/1/15
	NEW ACAD FIN CO/FIN CORP	8.0	1,100	1,122	114,668	2018/6/15
	NEW ENTERPRISE STONE & L	13.0	1,656	1,854	189,567	2018/3/15
	NEW ENTERPRISE STONE & L	11.0	700	668	68,320	2018/9/1
	NFR ENERGY LLC/FIN CORP	9.75	1,050	1,107	113,212	2017/2/15
	NIELSEN CO LUX SARL/THE	5.5	2,700	2,801	286,287	2021/10/1
	NIELSEN FINANCE LLC/CO	5.0	2,050	2,073	211,866	2022/4/15
	NII CAPITAL CORP	8.875	250	99	10,156	2019/12/15
	NII CAPITAL CORP	7.625	3,450	1,017	104,014	2021/4/1
	NII INTERNATL TELECOM SA	11.375	3,300	2,937	300,161	2019/8/15
	NII INTERNATL TELECOM SA	7.875	3,225	2,781	284,275	2019/8/15
	NORANDA ALUMINUM ACQUIST	11.0	975	996	101,887	2019/6/1
	NORTEK INC	8.5	2,425	2,697	275,716	2021/4/15
	NOVA CHEMICALS CORP	5.25	1,325	1,455	148,787	2023/8/1
	NOVELIS INC	8.75	3,000	3,352	342,625	2020/12/15
	NPC INTL/OPER CO A&B INC	10.5	550	621	63,517	2020/1/15
	NRG ENERGY INC	6.25	2,475	2,642	270,018	2022/7/15
	NRG ENERGY INC	6.25	1,475	1,554	158,847	2024/5/1
	NUMERICABLE GROUP SA	4.875	3,600	3,702	378,387	2019/5/15
	NUMERICABLE GROUP SA	6.0	5,200	5,428	554,780	2022/5/15
	NUMERICABLE GROUP SA	6.25	1,825	1,912	195,452	2024/5/15
	NUVEEN INVESTMENTS INC	9.125	925	1,005	102,806	2017/10/15
	NXP BV/NXP FUNDING LLC	5.75	1,000	1,057	108,076	2023/3/15
	OASIS PETROLEUM INC	6.5	1,050	1,136	116,163	2021/11/1
	ONCURE ESCROW 11.75%	—	1,250	—	—	2017/5/15
	ONCURE HOLDINGS INC	11.75	446	495	50,643	2017/1/15
	OPPENHEIMER HOLDINGS INC	8.75	678	727	74,315	2018/4/15
	ORION ENGINEERED CARB FI	9.25	2,275	2,378	243,083	2019/8/1
	ORTHO-CLINICAL DIAGNOSTI	6.625	4,375	4,347	444,330	2022/5/15
	OSHKOSH CORP	5.375	700	722	73,865	2022/3/1
	OWENS CORNING INC	7.0	2,175	2,611	266,891	2036/12/1
	OWENS-BROCKWAY	7.375	2,105	2,331	238,257	2016/5/15
	OWENS-ILLINOIS INC	7.8	600	703	71,897	2018/5/15
	PACIFIC DRILLING SA	5.375	1,725	1,712	174,972	2020/6/1
	PACIFIC DRILLING V LTD	7.25	775	828	84,670	2017/12/1
	PACNET LTD	9.0	200	217	22,228	2018/12/12
	PAETEC ESCROW CORP	9.875	1,000	1,081	110,478	2018/12/1
	PALACE ENT HLDG LLC/CORP	8.875	1,075	1,124	114,877	2017/4/15
	PANTRY INC	8.375	1,075	1,167	119,340	2020/8/1
PAR PHARMACEUTICAL COS I	7.375	950	1,030	105,342	2020/10/15	
PARKER DRILLING CO	6.75	1,175	1,236	126,389	2022/7/15	
PARSLEY ENERGY LLC/FINAN	7.5	325	348	35,623	2022/2/15	
PATRIOT MERGER CORP	9.0	2,350	2,585	264,187	2021/7/15	
PC NEXTCO HOLDINGS/FINAN	8.75	6,325	6,498	664,191	2019/8/15	
PEABODY ENERGY CORP	6.25	1,215	1,211	123,862	2021/11/15	
PENN NATIONAL GAMING INC	5.875	175	166	16,990	2021/11/1	
PENN VIRGINIA RESOURCE	6.5	1,075	1,174	120,027	2021/5/15	
PENSKE AUTO GROUP INC	5.75	975	1,026	104,876	2022/10/1	
PERRY ELLIS INTL INC	7.875	425	442	45,172	2019/4/1	
PERSTORP HOLDING AB	8.75	500	538	54,996	2017/5/15	

種 類	銘 柄 名	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	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	PETCO HOLDINGS INC	8.5	6,175	6,344	648,439	2017/10/15
	PETROBAKKEN ENERGY LTD	8.625	1,725	1,819	185,991	2020/2/1
	PINNACLE ENTERTAINMENT	7.75	175	191	19,539	2022/4/1
	PINNACLE FOODS FINANCE L	4.875	1,175	1,204	123,087	2021/5/1
	PINNACLE MERGER SUB INC	9.5	2,200	2,453	250,696	2023/10/1
	PINNACLE OPERATING CORP	9.0	1,600	1,748	178,645	2020/11/15
	PIONEER ENERGY SERVICES	6.125	975	1,011	103,381	2022/3/15
	PLAINS EXPLORATION & PRO	8.625	975	1,048	107,118	2019/10/15
	PLAINS EXPLORATION & PRO	6.5	250	278	28,498	2020/11/15
	PLAYA RESORTS HOLDINGS	8.0	200	215	22,024	2020/8/15
	PNK FINANCE CORP	6.375	4,500	4,770	487,494	2021/8/1
	POLYMER GROUP INC	6.875	1,150	1,171	119,733	2019/6/1
	POLYONE CORP	7.375	475	517	52,853	2020/9/15
	POLYONE CORP	5.25	1,475	1,524	155,832	2023/3/15
	POST HOLDINGS INC	6.75	1,700	1,814	185,467	2021/12/1
	POST HOLDINGS INC	7.375	625	675	69,004	2022/2/15
	POST HOLDINGS INC	6.0	1,850	1,896	193,796	2022/12/15
	PROQUEST LLC/PROQUEST	9.0	1,450	1,540	157,451	2018/10/15
	PROSPECT HLDG LLC/FINANC	10.25	1,650	1,629	166,522	2018/10/1
	QS WHOLESALE INC	7.875	1,600	1,640	167,608	2018/8/1
	QUADRA FX MINING LTD	7.75	875	942	96,355	2019/6/15
	QUEBECOR MEDIA INC	5.75	825	853	87,266	2023/1/15
	QUICKSILVER RESOURCES IN	9.125	600	558	57,049	2019/8/15
	QUIKSILVER INC/QS WHOLE	10.0	1,700	1,708	174,608	2020/8/1
	QVC INC	5.125	125	132	13,504	2022/7/2
	QWEST CORPORATION	7.25	425	440	45,016	2035/10/15
	RADIAN GROUP INC	5.5	1,350	1,385	141,591	2019/6/1
	RADIATION THERAPY SERVIC	8.875	750	771	78,853	2017/1/15
	RADIATION THERAPY SERVIC	9.875	775	716	73,264	2017/4/15
	RADIO SYSTEMS CORP	8.375	750	834	85,273	2019/11/1
	RADIO SHACK CORP	6.75	2,025	891	91,060	2019/5/15
	RAIN CII CARBON LLC/CII	8.25	425	448	45,823	2021/1/15
	RCN TELECM SER/CAPITAL	8.5	2,350	2,526	258,182	2020/8/15
	REALOGY GROUP/CO-ISSUER	4.5	3,100	3,107	317,612	2019/4/15
	REGAL ENTERTAINMENT GRP	5.75	875	903	92,331	2023/6/15
	REGAL ENTERTAINMENT GRP	5.75	275	279	28,596	2025/2/1
	REGENCY ENERGY PART/FIN	5.875	1,150	1,247	127,520	2022/3/1
	REGENCY ENERGY PARTNERS	4.5	1,375	1,380	141,077	2023/11/1
	RELIANCE INTERMEDIATE HO	9.5	800	860	87,892	2019/12/15
	RENAISSANCE ACQUISITION	6.875	3,425	3,619	369,871	2021/8/15
	RES-CARE INC	10.75	100	109	11,216	2019/1/15
	RESOLUTE FOREST PRODUCTS	5.875	4,325	4,303	439,804	2023/5/15
REVLON CONSUMER PRODS	5.75	1,075	1,109	113,435	2021/2/15	
REXEL	6.125	900	958	97,984	2019/12/15	
REXEL SA	5.25	1,550	1,617	165,311	2020/6/15	
REYNOLDS GROUP HOLDINGS	6.875	400	431	44,099	2021/2/15	
REYNOLDS GROUP HOLDINGS	8.25	5,400	5,879	600,859	2021/2/15	
REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD	8.5	450	471	48,174	2018/5/15	
REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD	9.0	3,975	4,229	432,244	2019/4/15	
REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD	7.875	350	381	39,034	2019/8/15	
REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD	9.875	6,600	7,326	748,717	2019/8/15	
REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD	5.75	1,520	1,603	163,887	2020/10/15	
RHP HOTEL PPTY/RHP FINAN	5.0	150	150	15,330	2021/4/15	
RITE AID CORP	6.75	3,725	4,023	411,150	2021/6/15	

種 類	銘 柄 名	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	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	RITE AID CORP	7.7	925	1,031	105,406	2027/2/15
	RITE AID CORP	6.875	1,475	1,489	152,252	2028/12/15
	ROYAL BK SCOTLAND GRP PLC	7.64	7,050	7,537	770,282	2049/3/29
	RR DONNELLEY & SONS CO	7.875	675	776	79,332	2021/3/15
	RR DONNELLEY & SONS CO	7.0	1,100	1,212	123,943	2022/2/15
	RR DONNELLEY & SONS CO	6.5	525	549	56,203	2023/11/15
	RR DONNELLEY & SONS CO	6.0	925	929	95,007	2024/4/1
	RRI ENERGY	7.875	225	240	24,604	2017/6/15
	RSC EQUIP RENT/RSC HLDGS	8.25	3,089	3,443	351,959	2021/2/1
	RSI HOME PRODUCTS INC	6.875	625	667	68,266	2018/3/1
	RUE21 INC	9.0	225	171	17,476	2021/10/15
	RYLAND GROUP	6.625	675	736	75,279	2020/5/1
	RYLAND GROUP	5.375	400	399	40,777	2022/10/1
	SABINE PASS LIQUEFACTION	5.875	100	106	10,841	2021/2/1
	SABINE PASS LIQUEFACTION	5.625	2,500	2,606	266,358	2023/4/15
	SABINE PASS LIQUEFACTION	5.625	300	312	31,963	2023/4/15
	SABINE PASS LIQUEFACTION	5.75	3,700	3,871	395,628	2024/5/15
	SABINE PASS LNG LP	7.5	775	838	85,739	2016/11/30
	SABRA HEALTH/CAPTL CORP	5.5	925	964	98,552	2021/2/1
	SABRE INC	8.5	1,065	1,187	121,359	2019/5/15
	SALLY HOLDINGS/SALLY CAP	5.75	525	563	57,544	2022/6/1
	SALLY HOLDINGS/SALLY CAP	5.5	950	980	100,245	2023/11/1
	SAMSON INVESTMENT CO	10.75	1,575	1,671	170,824	2020/2/15
	SANCHEZ ENERGY CORP	7.75	4,825	5,259	537,495	2021/6/15
	SANCHEZ ENERGY CORP	6.125	3,275	3,389	346,419	2023/1/15
	SANDRIDGE ENERGY INC	7.5	400	433	44,303	2021/3/15
	SANDRIDGE ENERGY INC	8.125	525	582	59,489	2022/10/15
	SANDRIDGE ENERGY INC	7.5	1,450	1,578	161,341	2023/2/15
	SANJEL CORP	7.5	1,100	1,102	112,701	2019/6/19
	SAPPI PAPIER HOLDNG GMBH	8.375	1,450	1,602	163,749	2019/6/15
	SAPPI PAPIER HOLDNG GMBH	6.625	75	79	8,101	2021/4/15
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5.625	50	53	5,429	2019/10/1
	SCHAEFFLER FINANCE BV	4.25	2,800	2,810	287,235	2021/5/15
	SCHAEFFLER HLDG FIN BV	6.875	1,275	1,348	137,813	2018/8/15
	SEADRILL LTD	6.625	1,600	1,632	166,865	2020/9/15
	SEALED AIR CORP	8.125	225	248	25,438	2019/9/15
	SEALED AIR CORP	8.375	475	546	55,826	2021/9/15
	SEALED AIR CORP	5.25	725	741	75,762	2023/4/1
	SEITEL INC	9.5	1,350	1,458	149,007	2019/4/15
	SELECT MEDICAL CORP	6.375	475	501	51,214	2021/6/1
	SEMINOLE HARD ROCK EXT I	5.875	1,000	1,005	102,711	2021/5/15
	SERVICE CORP INTL	6.75	3,500	3,788	387,210	2016/4/1
	SERVICE CORP INTL	7.0	1,250	1,403	143,399	2017/6/15
SERVICE CORP INTL	4.5	600	598	61,166	2020/11/15	
SERVICE CORP INTL	8.0	1,250	1,481	151,383	2021/11/15	
SERVICE CORP INTL	5.375	4,600	4,784	488,924	2022/1/15	
SERVICE CORP INTL	5.375	825	849	86,844	2024/5/15	
SERVICEMASTER COMPANY	7.0	550	587	60,074	2020/8/15	
SESI LLC	7.125	725	821	83,912	2021/12/15	
SEVEN GENERATIONS ENERGY	8.25	2,600	2,873	293,620	2020/5/15	
SHEA HOMES LP/FNDG CP	8.625	413	452	46,218	2019/5/15	
SHEARERS FOODS	9.0	350	385	39,347	2019/11/1	
SIDEWINDER DRILLING INC	9.75	1,775	1,819	185,940	2019/11/15	
SIGNODE INDUSTRIAL GROUP	6.375	1,850	1,882	192,378	2022/5/1	

種 類	銘 柄 名	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	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	SINCLAIR TELEVISION GROU	5.375	800	811	82,884	2021/4/1
	SINCLAIR TELEVISION GROU	6.375	2,775	2,955	302,039	2021/11/1
	SIRIUS XM RADIO INC	4.625	2,150	2,053	209,842	2023/5/15
	SLM CORP	5.5	2,025	2,156	220,407	2019/1/15
	SLM CORP	8.0	9,200	10,683	1,091,853	2020/3/25
	SLM CORP	7.25	1,250	1,385	141,642	2022/1/25
	SLM CORP	5.5	2,200	2,180	222,872	2023/1/25
	SLM CORP	6.125	2,975	3,023	308,985	2024/3/25
	SM ENERGY CO	6.5	125	135	13,828	2021/11/15
	SM ENERGY CO	6.5	425	461	47,126	2023/1/1
	SOCIETE GENERALE	6.0	200	198	20,330	2049/10/27
	SOCIETE GENERALE	6.0	400	397	40,649	2049/12/31
	SONIC AUTOMOTIVE INC	7.0	3,000	3,300	337,260	2022/7/15
	SONIC AUTOMOTIVE INC	5.0	725	714	72,983	2023/5/15
	SOPHIA HOLDING FIN LP/IN	9.625	200	208	21,257	2018/12/1
	SPCM SA	6.0	100	107	10,960	2022/1/15
	SPECTRUM BRANDS HLDGS	6.75	175	187	19,136	2020/3/15
	SPECTRUM BRANDS INC	6.375	275	297	30,423	2020/11/15
	SPECTRUM BRANDS INC	6.625	800	868	88,709	2022/11/15
	SPENCER SPIRIT HLDG/GIFT	11.0	525	558	57,075	2017/5/1
	SPENCER SPIRIT HOLDINGS	9.0	3,525	3,604	368,360	2018/5/1
	SPIRIT AEROSYSTEMS INC	6.75	600	649	66,378	2020/12/15
	SPIRIT AEROSYSTEMS INC	5.25	1,050	1,071	109,456	2022/3/15
	SPRINGLEAF FINANCE CORP	6.9	7,175	8,000	817,612	2017/12/15
	SPRINGLEAF FINANCE CORP	7.75	900	1,017	103,937	2021/10/1
	SPRINGLEAF FINANCE CORP	8.25	900	1,030	105,317	2023/10/1
	SPRINT CAPITAL CORP	6.9	900	999	102,097	2019/5/1
	SPRINT CAPITAL CORP	6.875	1,425	1,458	149,093	2028/11/15
	SPRINT CAPITAL CORP	8.75	6,875	8,009	818,558	2032/3/15
	SPRINT COMMUNICATIONS	6.0	4,800	4,932	504,050	2022/11/15
	SPRINT NEXTEL CORP	9.125	800	940	96,068	2017/3/1
	SPRINT NEXTEL CORP	7.0	500	577	59,020	2020/3/1
	SPRINT NEXTEL CORP	11.5	9,600	13,056	1,334,323	2021/11/15
	SRA INTERNATIONAL INC	11.0	1,075	1,158	118,379	2019/10/1
	ST BARBARA LTD	8.875	325	269	27,568	2018/4/15
	STACKPOLE INTL INTER CO	7.75	1,450	1,522	155,599	2021/10/15
	STANDARD PACIFIC CORP	8.375	1,000	1,190	121,618	2021/1/15
	STAR GAS PARTNER/FINANCE	8.875	375	397	40,624	2017/12/1
	STEEL DYNAMICS INC	6.125	450	491	50,244	2019/8/15
	STEEL DYNAMICS INC	6.375	975	1,062	108,613	2022/8/15
	STENA AB	7.0	1,800	1,930	197,297	2024/2/1
	STONERIDGE INC	9.5	700	749	76,547	2017/10/15
	SUBURBAN PROPANE PARTNRS	5.5	1,825	1,847	188,846	2024/6/1
SUGAR HSP GMNG PROP/FIN	6.375	1,050	1,031	105,432	2021/6/1	
SUMMIT MATERIALS LLC/FIN	10.5	1,250	1,412	144,357	2020/1/31	
SUMMIT MID HLDS LLC / FI	7.5	2,075	2,277	232,741	2021/7/1	
SUN MERGER SUB INC	5.25	800	836	85,439	2018/8/1	
SUNCOKE ENRGY PART LP/FI	7.375	525	562	57,477	2020/2/1	
SUNCOKE ENRGY PART LP/FI	7.375	1,000	1,071	109,481	2020/2/1	
SUNGARD AVAIL SERV CAP	8.75	1,750	1,631	166,777	2022/4/1	
SUNGARD DATA SYSTEMS INC	6.625	3,950	4,187	427,911	2019/11/1	
SWIFT SERVICES HLDGS INC	10.0	3,800	4,106	419,671	2018/11/15	
SYNCREON GROUP BV/SYNCRE	8.625	4,450	4,550	465,022	2021/11/1	
T-MOBILE USA INC	6.464	475	501	51,214	2019/4/28	

種 類	銘 柄 名	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	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	T-MOBILE USA INC	6.542	1,450	1,567	160,230	2020/4/28
	T-MOBILE USA INC	6.25	1,275	1,359	138,937	2021/4/1
	T-MOBILE USA INC	6.731	975	1,054	107,741	2022/4/28
	T-MOBILE USA INC	6.625	2,375	2,588	264,570	2023/4/1
	T-MOBILE USA INC	6.836	450	491	50,186	2023/4/28
	TALOS PRODUCTION LLC/FIN	9.75	4,625	4,925	503,398	2018/2/15
	TAMINCO GLOBAL	9.75	1,800	2,016	206,035	2020/3/31
	TARGA RESOURCES PARTNERS	6.875	425	462	47,289	2021/2/1
	TAYLOR MORRISON COMM/MON	7.75	162	176	18,087	2020/4/15
	TAYLOR MORRISON COMM/MON	5.625	1,450	1,450	148,190	2024/3/1
	TEKNI-PLEX INC	9.75	2,025	2,262	231,272	2019/6/1
	TELEFLEX INC	6.875	600	640	65,459	2019/6/1
	TEMBEC INDUSTRIES INC	11.25	200	217	22,228	2018/12/15
	TEMPEL STEEL COMPANY	12.0	1,025	1,019	104,231	2016/8/15
	TENET HEALTHCARE CORP	5.0	4,650	4,722	482,615	2019/3/1
	TENET HEALTHCARE CORP	8.125	2,850	3,298	337,145	2022/4/1
	TEREX CORP	6.0	675	729	74,503	2021/5/15
	TERVITA CORP	8.0	2,150	2,257	230,716	2018/11/15
	TESORO CORP	5.125	1,200	1,210	123,713	2024/4/1
	TESORO LOGISTICS LP/CORP	5.875	675	717	73,296	2020/10/1
	TESORO LOGISTICS LP/CORP	6.125	2,575	2,761	282,244	2021/10/15
	THE MEN'S WEARHOUSE INC	7.0	1,125	1,184	121,011	2022/7/1
	THOMPSON CREEK METALS CO	9.75	700	796	81,376	2017/12/1
	THOMPSON CREEK METALS CO	7.375	525	521	53,252	2018/6/1
	THOMPSON CREEK METALS CO	12.5	425	484	49,515	2019/5/1
	TITAN INTERNATIONAL INC	6.875	1,800	1,845	188,559	2020/10/1
	TMS INTERNATIONAL CORP	7.625	475	510	52,185	2021/10/15
	TMX FIN LLC/TITLEMAX FIN	8.5	2,550	2,725	278,526	2018/9/15
	TOLL BROS FINANCE CORP	4.0	475	489	50,001	2018/12/31
	TOLL BROS FINANCE CORP	6.75	300	347	35,488	2019/11/1
	TOLL BROS FINANCE CORP	5.625	1,875	2,006	205,038	2024/1/15
	TOPAZ MARINE SA	8.625	400	433	44,252	2018/11/1
	TOPS HLDG CORP/TOPS MKTS	8.875	1,225	1,338	136,775	2017/12/15
	TOPS HOLDING II CORP	8.75	2,925	3,063	313,134	2018/6/15
	TPC GROUP INC	8.75	1,525	1,692	172,999	2020/12/15
	TRAC INTERMODAL LLC/CORP	11.0	775	887	90,689	2019/8/15
	TRANSDIGM INC	6.0	2,575	2,665	272,375	2022/7/15
	TRANSDIGM INC	6.5	1,800	1,881	192,238	2024/7/15
	TRANSFIELD SERVICES LTD	8.375	925	954	97,500	2020/5/15
	TRANSUNION HOLDING CO	8.125	2,175	2,278	232,843	2018/6/15
	TRAVELPORT LLC	13.875	5,545	5,739	586,559	2016/3/1
	TRAVELPORT LLC	11.875	700	716	73,239	2016/9/1
TRINIDAD DRILLING LTD	7.875	425	451	46,149	2019/1/15	
TRINSEO OP / TRINSEO FIN	8.75	2,900	3,124	319,349	2019/2/1	
TRIUMPH GROUP INC	4.875	1,350	1,356	138,659	2021/4/1	
TULLOW OIL PLC	6.0	1,200	1,253	128,144	2020/11/1	
TULLOW OIL PLC	6.25	2,800	2,922	298,659	2022/4/15	
TW TELECOM HOLDINGS INC	5.375	1,800	1,973	201,666	2022/10/1	
TW TELECOM HOLDINGS INC	6.375	3,075	3,505	358,262	2023/9/1	
U. S. FOODSERVICE	8.5	1,175	1,257	128,566	2019/6/30	
UNIFRAX I LLC/UNIFRAX HO	7.5	4,250	4,483	458,239	2019/2/15	
UNISYS CORP	6.25	575	626	64,053	2017/8/15	
UNIT CORP	6.625	1,150	1,233	126,050	2021/5/15	
UNITED AIR 2014-1 B PTT	4.75	500	508	51,930	2022/4/11	

種 類	銘 柄 名	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	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	UNITED CONTINENTAL HLDGS	6.0	725	759	77,614	2020/12/1
	UNITED REFINING	10.5	504	555	56,788	2018/2/28
	UNITED RENTALS NORTH AM	7.375	1,409	1,563	159,839	2020/5/15
	UNITED RENTALS NORTH AM	6.125	1,375	1,479	151,162	2023/6/15
	UNITED RENTALS NORTH AM	5.75	2,175	2,272	232,287	2024/11/15
	UNITYMEDIA HESSEN / NRW	5.5	1,875	1,950	199,290	2023/1/15
	UNIVERSAL HOSPITAL SERVI	7.625	1,125	1,182	120,867	2020/8/15
	UNIVISION COMMUNICATIONS	6.875	9,338	9,944	1,016,375	2019/5/15
	UNIVISION COMMUNICATIONS	6.75	1,899	2,122	216,881	2022/9/15
	US AIRWAYS 2012-2B PTT	6.75	215	235	24,102	2021/6/3
	US AIRWAYS 2012-2C PTT	5.45	300	309	31,656	2018/6/3
	US AIRWAYS GROUP INC	6.125	1,425	1,506	154,009	2018/6/1
	US STEEL CORP	6.875	300	320	32,729	2021/4/1
	VALEANT PHARMACEUTICALS	5.625	1,000	1,030	105,266	2021/12/1
	VANDER INTERMEDIATE HOLD	9.75	650	700	71,578	2019/2/1
	VECTOR GROUP LTD	7.75	1,200	1,290	131,838	2021/2/15
	VERISIGN INC	4.625	775	765	78,214	2023/5/1
	VERSO PAPER HLDGS LLC/IN	11.75	1,450	1,554	158,881	2019/1/15
	VIASAT INC	6.875	1,725	1,875	191,698	2020/6/15
	VIDEOTRON LTEE	6.375	600	603	61,626	2015/12/15
	VIKING CRUISES LTD	8.5	775	864	88,313	2022/10/15
	VIMPELCOM HLDGS	7.5043	1,825	1,976	202,016	2022/3/1
	VIRGIN MEDIA FINANCE PLC	8.375	400	423	43,283	2019/10/15
	VISANT CORP	10.0	1,050	987	100,871	2017/10/1
	VPII ESCROW CORP	6.75	1,400	1,512	154,526	2018/8/15
	VPII ESCROW CORP	7.5	1,725	1,916	195,907	2021/7/15
	VTR FINANCE BV	6.875	1,800	1,924	196,675	2024/1/15
	VWR FUNDING INC	7.25	1,975	2,091	213,703	2017/9/15
	WATCO COS LLC/FINANCE CO	6.375	1,125	1,153	117,849	2023/4/1
	WATERJET HOLDINGS INC	7.625	400	427	43,639	2020/2/1
	WAVE HOLDCO LLC/CORP	8.25	975	1,005	102,758	2019/7/15
	WAVEDIVISION ESCROW/WAVE	8.125	2,250	2,446	250,070	2020/9/1
	WELLCARE HEALTH PLANS IN	5.75	775	829	84,749	2020/11/15
	WELLS ENTERPRISES INC	6.75	200	210	21,538	2020/2/1
	WELLS FARGO & COMPANY	5.9	1,000	1,060	108,367	2049/12/29
	WIDEOPENWEST FIN/CAPITAL	10.25	650	732	74,816	2019/7/15
	WILLIAM LYON HOMES INC	5.75	425	437	44,738	2019/4/15
	WILLIAM LYON HOMES INC	8.5	1,625	1,824	186,419	2020/11/15
	WIND ACQUISITION FIN SA	7.25	825	872	89,163	2018/2/15
	WIND ACQUISITION FIN SA	7.375	1,600	1,720	175,784	2021/4/23
	WINDSTREAM CORP	7.875	721	836	85,475	2017/11/1
	WINDSTREAM CORP	7.5	4,625	5,047	515,806	2022/6/1
WINDSTREAM CORP	7.5	5,090	5,529	565,065	2023/4/1	
WINDSTREAM CORP	6.375	8,275	8,368	855,219	2023/8/1	
WINDSTREAM HLDGS MIDWEST	6.75	1,375	1,368	139,822	2028/4/1	
WISE HLDG/FIN CORP	9.75	900	921	94,164	2019/6/15	
WISE METALS GROUP LLC/WI	8.75	3,350	3,651	373,183	2018/12/15	
WMG ACQUISITION CORP	5.625	200	201	20,542	2022/4/15	
WMG ACQUISITION CORP	6.75	900	904	92,439	2022/4/15	
WMG HOLDINGS CORP	13.75	600	718	73,430	2019/10/1	
WOODSIDE HOMES CO LLC/FI	6.75	125	128	13,102	2021/12/15	
合 計		-	-	-	143,504,046	-

*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。

◎投資信託財産の構成

(2014年7月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	1,256,831	0.8
公 社 債	143,504,046	94.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,812,703	5.1
投 資 信 託 財 産 総 額	152,573,580	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産(149,540,836千円)の投資信託財産総額(152,573,580千円)に対する比率は98.0%です。

*外貨建て資産は、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=102.20円。

◎資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2014年7月7日)現在

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	153,217,062,496
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,216,657,042
株 式 (評 価 額)	1,256,831,558
公 社 債 (評 価 額)	143,504,046,366
未 収 入 金	766,253,667
未 収 利 息	2,339,941,486
前 払 費 用	133,332,377
(B) 負 債	3,007,166,845
未 払 金	1,404,366,845
未 払 解 約 金	1,602,800,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	150,209,895,651
元 本	64,771,545,473
次 期 繰 越 損 益 金	85,438,350,178
(D) 受 益 権 総 口 数	64,771,545,473口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,191円

◎損益の状況

(自2013年7月6日 至2014年7月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	9,978,283,583
受 取 配 当 金	67,075,748
受 取 利 息	9,805,000,796
そ の 他 収 益 金	106,207,039
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	10,386,570,591
売 買 益	11,636,531,655
売 買 損	△ 1,249,961,064
(C) 信 託 報 酬 等	△ 59,106,741
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	20,305,747,433
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	67,236,019,797
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	37,458,773,628
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 39,562,190,680
(H) 計 (D + E + F + G)	85,438,350,178
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	85,438,350,178

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

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

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

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

(注)期首元本額66,985百万円、期中追加設定元本額31,735百万円、期中一部解約元本額33,949百万円、計算口数当たり純資産額23,191円。

(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、高利回り社債オープン22,465百万円、高利回り社債オープン・為替ヘッジ26,988百万円、米欧ハイ・インカムオープン458百万円、野村米国ハイ・イールド・ファンド(毎月決算型)8,961百万円、野村米国ハイ・イールド・ファンド(毎月決算型)為替ヘッジあり4,614百万円、高利回り社債オープン・為替ヘッジ(年1回決算型)87百万円、高利回り社債オープン(年1回決算型)30百万円、野村米国ハイ・イールド・ファンド(年1回決算型)868百万円、野村米国ハイ・イールド・ファンド(年1回決算型)為替ヘッジあり262百万円、高利回り社債オープンVA(適格機関投資家専用)33百万円。