# 野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース) 毎月分配型

# 運用報告書(全体版)

第192期(決算日2025年2月25日) 第193期(決算日2025年3月25日) 第194期(決算日2025年4月25日) 第195期(決算日2025年5月26日) 第196期(決算日2025年6月25日) 第197期(決算日2025年7月25日)

作成対象期間(2025年1月28日~2025年7月25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。

●当ファンドの什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	2009年1月28日から2029年1月25日までです。	
運用方針	籍の投資信託である野村マネー マザーファンド受益証券へまたは「ハイ・イールド債」といいます。)を実質的な主要長を図ることを目的として運用を行ないます。各受益証券、・ファンド(TRY Class)受益証券への投資を中心としますびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定することを	
主な投資対象	野村木国ハイ・イールト領券技信 ザーファンド (トルコリラコース)毎月分配型 有価証券なら	マン・ハイ・イールド・ファンド(TRY Class) 受益証券および野村マネー マ 受益証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期 『に短期金融商品等に直接投資する場合があります。
2010000	フムラ・ケイマン・ハイ・イールド・ファフト 米ドル建てので	高利回り事業債を主要投資対象とします。 
	野村マネー マザーファンド 本邦通貨表示	D短期有価証券を主要投資対象とします。
主な投資制限		への投資割合には制限を設けません。 D直接投資は行ないません。
	野村マネー マザーファンド 株式への投資(	ま行ないません。
分配方針	なる場合があります。また、毎年1月および7月の決算時 で委託者が決定する額を付加して分配する場合があります。 ないます。 「原則として、利子・配当等収益等を中心に安定分配を行な	を分配を行ないます。ただし、基準価額水準等によっては売買益等が中心とには、基準価額水準等を勘案し、安定分配相当額のほか、分配原資の範囲内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が、これは、運用による収益が安定したものになるではありません。また、基準価額の水準、運用の状況等によっては安定分配

#### 野村アセットマネジメント株式会社

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

●サポートダイヤル

0120-753104 〈受付時間〉 営業日の午前9時~午後5時

●ホームページ

https://www.nomura-am.co.jp/

# 〇最近30期の運用実績

			基	準 価	額	債 券	債 券	投資信託	純 資 産
決	算	期	(分配落)	税 込 み分 配 金	期 中騰落率	債 券 組入比率	先 物 比 率	証券組入比率	総額
			円	円	%	%	%	%	百万円
168‡	期(2023年2)	月27日)	2, 316	5	2. 2	0.0	_	98. 9	2, 126
169‡	期(2023年3)	月27日)	2, 238	5	△3. 2	0.0	_	98. 7	2,043
170基	期(2023年4)	月25日)	2, 375	5	6. 3	0.0	_	98. 2	2, 117
171	期(2023年5	月25日)	2, 501	5	5. 5	0.0	_	98. 7	2, 173
172‡	期(2023年6)	月26日)	2, 382	5	△4. 6	0.0	_	99. 0	1, 953
173‡	期(2023年7)	月25日)	2, 142	5	△9. 9	0.0	_	98. 4	1,725
174‡	期(2023年8)	月25日)	2, 187	5	2. 3	0.0	_	98. 9	1,731
175‡	期(2023年9	月25日)	2, 295	5	5. 2	0.0	_	99. 2	1,773
176‡	期(2023年10	月25日)	2, 239	5	△2. 2	0.0	_	98.8	1,725
177‡	期(2023年11	月27日)	2, 326	5	4. 1	0.0	_	98. 6	1, 759
178	期(2023年12	月25日)	2, 330	5	0.4	0.0	_	98. 5	1,745
179‡	期(2024年1)	月25日)	2, 380	5	2. 4	0.0	_	98.8	1,758
180	期(2024年2)	月26日)	2, 432	5	2. 4	0.0	_	98.8	1, 785
181	朝(2024年3)	月25日)	2, 471	5	1.8	0.0		99. 0	1,789
182	期(2024年4)	月25日)	2, 558	5	3. 7	0.0	_	98.8	1, 798
183	朝(2024年5)	月27日)	2, 735	5	7. 1	0.0	_	98. 9	1,910
184	朝(2024年6)	月25日)	2,819	5	3. 3	0.0	_	98. 4	1,973
185‡	朝(2024年7)	月25日)	2,841	5	1.0	0.0	_	98.8	1, 949
186	朝(2024年8)	月26日)	2, 705	5	△4. 6	0.0	_	98. 5	1,861
187 <b></b>	期(2024年9	月25日)	2,778	5	2. 9	0.0	_	98. 6	1,903
188‡	期(2024年10	月25日)	2, 984	5	7. 6	0.0	_	99. 1	2,015
189‡	期(2024年11	月25日)	3, 106	5	4. 3	0.0	_	98. 0	2,090
190‡	期(2024年12	月25日)	3, 161	5	1.9	0.0	_	99. 2	2,057
191‡	期(2025年1)	月27日)	3, 227	5	2. 2	0.0	_	98. 7	2,073
192‡	期(2025年2)	月25日)	3, 155	5	△2. 1	0.0	_	98. 7	2,018
193其	期(2025年3)	月25日)	3,022	5	△4. 1	0.0		98. 7	1,931
194	期(2025年4)	月25日)	2, 961	5	△1.9	0.0		99. 0	1,893
195‡	期(2025年5	月26日)	3, 048	5	3. 1	0.0	=	98. 9	1, 943
196‡	期(2025年6)	月25日)	3, 179	5	4. 5	0.0		95. 9	2,020
197其	期(2025年7)	月25日)	3, 253	5	2.5	0.0		98. 4	1,994

<sup>\*</sup>基準価額の騰落率は分配金込み。

<sup>\*</sup>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。

<sup>\*</sup>債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

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

# 〇当作成期中の基準価額と市況等の推移

₹h	Parks.	440	ري. احد		基	準	価		額	債		券	債			券	投	資	信	託光
決	算	期	年	月 日			騰	落	率	組	入 爿	2 率	先	物	比	率	証組	入	比	券率
			(期	首)		円			%			%				%				%
			2025年	1月27日		3, 227			_			0.0				_			98	3. 7
	第192期		1	月末		3, 233			0.2			0.0				_			98	3. 9
			(期	末)																
			2025年	2月25日		3, 160		$\triangle$	2. 1			0.0				_			98	3. 7
			(期	首)																
			2025年	2月25日		3, 155			_			0.0				_			98	3. 7
	第193期		2	月末		3, 153		Δ	<b>\( 0.1</b>			0.0				_			98	3. 2
			(期	末)																
			2025年	3月25日		3,027		$\triangle$	4. 1			0.0				_			98	3. 7
			(期	首)																
			2025年	3月25日		3,022			_			0.0				_			98	3. 7
	第194期		3	月末		3,083			2.0			0.0				_			98	3. 7
			(期	末)																
			2025年	4月25日		2,966		$\triangle$	1.9			0.0				_			99	9. 0
			(期	首)																
			2025年	4月25日		2,961			_			0.0				_			99	9.0
	第195期		4	月末		2, 993			1.1			0.0				_			99	9. 1
			(期	末)																
			2025年	5月26日		3,053			3. 1			0.0				_			98	3. 9
			(期	首)																
			2025年	5月26日		3,048			_			0.0				_			98	3. 9
	第196期		5	月末		3,092			1.4			0.0				_			98	3. 9
			(期	末)																
			2025年	6月25日		3, 184			4.5			0.0				_			95	5. 9
			(期	首)	_															
			2025年	6月25日		3, 179			_			0.0				_			95	5. 9
	第197期		6	月末	_	3, 172		$\triangle$	△0. 2			0.0				_			98	3. 7
			(期	末)																
			2025年	7月25日		3, 258			2.5			0.0				_			98	3. 4

<sup>\*</sup>期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。 \*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

<sup>\*</sup>債券先物比率は買い建て比率一売り建て比率。

#### ◎運用経過

### 〇作成期間中の基準価額等の推移



第192期首: 3,227円

第197期末: 3.253円(既払分配金(税込み): 30円)

騰 落 率: 1.8% (分配金再投資ベース)

- (注)分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2025年1月27日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注)分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 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。

#### 〇基準価額の主な変動要因

- ・実質的に投資しているハイ・イールド債券からのインカムゲイン(利子収入)を得たこと
- ・実質的に投資しているハイ・イールド債券が上昇したこと
- トルコリラに対して円高が進んだこと

#### 〇投資環境

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)。2025年3月にトランプ米政権による関税政策の不透明感や景気の先行きに対する不安からセンチメント(市場心理)が悪化し、スプレッド(利回り格差)が拡大したことなどを背景に下落する局面もありましたが、その後、トランプ米政権と貿易相手国・地域との関税交渉が進展するとの期待が高まりスプレッドが縮小したことや、イランとイスラエルが停戦に合意したとの報道を受けて中東情勢への緊張が緩和したことなどから上昇し、当作成期間では上昇となりました。

#### 〇当ファンドのポートフォリオ

#### [野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型]

[ノムラ・ケイマン・ハイ・イールド・ファンド(TRY Class)] 受益証券および [野村マネーマザーファンド] 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする [ノムラ・ケイマン・ハイ・イールド・ファンド(TRY Class)] 受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持しました。

# [ノムラ・ケイマン・ハイ・イールド・ファンド(TRY Class)]

主要投資対象である [ノムラ・ケイマン・ハイ・イールド・ファンド] のハイ・イールド債ポートフォリオにおける信用格付け別比率については、2025年6月末時点で、BBB格以上2.0%、BB格38.2%、B格50.3%、CCC格以下3.5%となりました。

#### [野村マネー マザーファンド]

残存1年以内の公社債等(現先取引も含む)やコール・ローン等で運用を行なうことで、安定した収益と流動性の確保を図りました。

第196期

2025/6/25

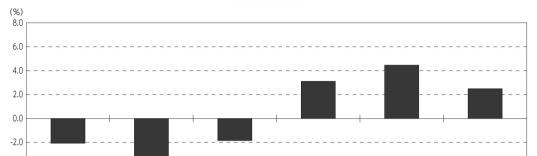
#### 〇当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、作成期間中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。

第193期

2025/3/25



■ 基準価額

第195期

2025/5/26

基準価額(期別騰落率)

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

第192期

2025/2/25

#### (注) 整学側観の臑洛学は力乱並込みです

# 収益分配金は当ファンドの分配方針に基づき、次表の通りとさせていただきました。

第194期

2025/4/25

#### 〇分配原資の内訳

**○分配金** 

-4.0 -6.0

(単位:円、1万口当たり・税込み)

第197期

2025/7/25

	_	第192期	第193期	第194期	第195期	第196期	第197期
項		2025年1月28日~ 2025年2月25日					2025年6月26日~ 2025年7月25日
当期分配金		5	5	5	5	5	5
(対基準価額比率)	1	0. 158%	0. 165%	0.169%	0.164%	0. 157%	0. 153%
当期の収益		5	5	5	5	5	5
当期の収益以外		_	_	_	_	_	_
翌期繰越分配対象	褶	6, 503	6, 514	6, 526	6, 540	6, 554	6, 568

- (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。
- (注) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の 分配金をお支払いすることはございません。

#### ◎今後の運用方針

#### [野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型]

[ノムラ・ケイマン・ハイ・イールド・ファンド(TRY Class)] 受益証券および [野村マネーマザーファンド] 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする [ノムラ・ケイマン・ハイ・イールド・ファンド(TRY Class)] 受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持します。

#### [ノムラ・ケイマン・ハイ・イールド・ファンド(TRY Class)]

米ドル建ての高利回り事業債(「ハイ・イールド・ボンド」または「ハイ・イールド債」といいます。)を主要投資対象とし、インカムゲインの確保に加え、中長期的なキャピタルゲイン(値上がり益)の獲得を目指します。

また、外国為替予約取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引等を活用し、米ドル建て資産について、原則として米ドルを売り、トルコリラを買う為替取引を行ないます。

今後は、米国の金利低下に加え、引き続きAIへの投資が旺盛であること、銀行に課せられている自己資本規制の緩和が計画されていることなどが市場の下支えになると考えています。 FRB(米連邦準備制度理事会)による金融政策を注視しつつ、トランプ米政権による関税政策の影響が大きいセクターには注意を払いながら、銘柄を選定して運用を行ないます。

なお、当ファンドは証拠金規制に則り、規制対象取引の評価損益について取引の相手方と証拠金の授受を行なう場合があります。

# [野村マネー マザーファンド]

残存1年以内の公社債等(現先取引も含む)やコール・ローン等で運用を行なうことで、安定した収益と流動性の確保を図ります。

#### ※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

店頭デリバティブ取引等の金融取引に関して、国際的に規制の強化が行なわれており、ファンドが実質的に活用する当該金融取引が当該規制強化等の影響をうけ、当該金融取引を行なうための担保として現金等を提供する必要がある場合があります。その場合、追加的に現金等を保有するため、ファンドの実質的な主要投資対象の組入比率が下がり、高位に組入れた場合に期待される投資効果が得られないことが想定されます。また、その結果として、実質的な主要投資対象を高位に組入れた場合と比べてファンドのパフォーマンスが悪化する場合があります。

#### 〇1万口当たりの費用明細

(2025年1月28日~2025年7月25日)

	項				 目		第1	192期~	~第19	7期	項 目 の 概 要						
	垬				Ħ		金	額	比	率	切り 気 安						
								円		%							
(a)	(a) 信 託 報 酬 15						15	0.	475	(a)信託報酬=作成期間の平均基準価額×信託報酬率							
	(投信会社)					)		(6)	(0.	189)	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	)		(8)	(0.	270)	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	숲	社	)		(1)	(0.	016)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等						
(b)	そ	の	H	ł <u>t</u>	費	用		0	0.	001	(b)その他費用=作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数						
	(	監	查	費	用	)		(0)	(0.	001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用						
	合 計 15 0.476							15	0.	476							
	作成期間の平均基準価額は、3,121円です。						3, 12	21円で	す。								

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

<sup>\*</sup>各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

<sup>\*</sup>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。

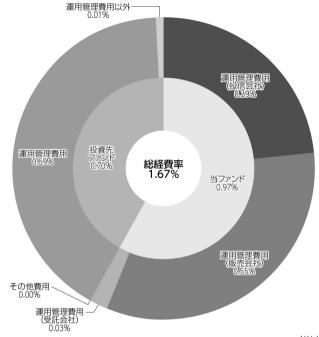
<sup>\*</sup>各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)が支払った費用を含みません。

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

#### (参考情報)

#### 〇総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.67%です。



(単位:%)

総経費率 (①+②+③)	1.67
①当ファンドの費用の比率	0.97
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.69
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.01

- (注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
- (注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。
- (注) 各比率は、年率換算した値です。
- (注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券等(マザーファンドを除く。)です。
- (注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
- (注) 当ファンドのその他費用には、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用が含まれます。
- (注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。
- (注) 投資先ファンドの純資産総額等によっては、投資先ファンドの運用管理費用以外の比率が高まる場合があります。
- (注) 投資先ファンドの費用は、交付運用報告書作成時点において、委託会社が知りうる情報をもとに作成しています。
- (注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

(2025年1月28日~2025年7月25日)

#### 投資信託証券

Ī				第192期~第197期									
		銘	柄		買	付			売	付			
					数	金	額		数	金	額		
	用				П		千円				千円		
	内	ノムラ・ケイマン・ハイ	・イールド・ファンド(TRY Class)		21, 435		33, 401		52,890		85, 802		

<sup>\*</sup>金額は受け渡し代金。

#### 〇利害関係人との取引状況等

(2025年1月28日~2025年7月25日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

#### ○組入資産の明細

(2025年7月25日現在)

### ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘	柄	第19	第191期末 第197期末							
<b>少</b> 白	113	П	数	П	数	評	価	額	比	率
			П		П			千円		%
ノムラ・ケイマン・ハイ・イ	ールド・ファンド(TRY Class)	1,	217, 706	1	, 186, 251		1, 96	3, 245		98.4
合	計	1,	217, 706	1	, 186, 251		1, 96	3, 245		98.4

<sup>\*</sup>比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

#### 親投資信託残高

D.G.	梅	第193	7期末	期末			
鄞	銘 柄		数	口	数	評	価 額
			千口		千口		千円
野村マネー マザーファン	K.		982		982		1,005

<sup>\*</sup>口数・評価額の単位未満は切り捨て。

<sup>\*</sup>金額の単位未満は切り捨て。

<sup>\*</sup>評価額の単位未満は切り捨て。

# 〇投資信託財産の構成

(2025年7月25日現在)

項	<b>a</b>		第197期末						
世	Ħ	評	価	額	比	率			
				千円		%			
投資信託受益証券				1, 963, 245		98. 1			
野村マネー マザーファンド				1,005		0.1			
コール・ローン等、その他				36, 747		1.8			
投資信託財産総額			<u> </u>	2, 000, 997		100. 0			

<sup>\*</sup>金額の単位未満は切り捨て。

# ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

		第192期末	第193期末	第194期末	第195期末	第196期末	第197期末
	項目	2025年2月25日現在	2025年3月25日現在	2025年4月25日現在	2025年5月26日現在	2025年6月25日現在	2025年7月25日現在
		円	円	円	円	円	円
(A)	資産	2, 025, 896, 038	1, 936, 275, 058	1, 903, 163, 166	1, 949, 878, 310	2, 025, 437, 362	2, 000, 997, 456
	コール・ローン等	32, 725, 146	29, 696, 509	28, 045, 387	26, 737, 546	36, 562, 316	36, 746, 155
	投資信託受益証券(評価額)	1, 992, 167, 016	1, 905, 574, 320	1, 874, 113, 178	1, 922, 135, 789	1, 937, 868, 492	1, 963, 245, 405
	野村マネー マザーファンド(評価額)	1, 003, 439	1, 003, 832	1, 004, 225	1, 004, 618	1, 005, 011	1, 005, 404
	未収入金	_	_	_	_	50, 001, 054	_
	未収利息	437	397	376	357	489	492
(B)	負債	7, 400, 593	4, 690, 775	10, 083, 478	5, 938, 049	4, 760, 029	6, 454, 740
	未払収益分配金	3, 198, 811	3, 196, 075	3, 196, 653	3, 188, 873	3, 177, 830	3, 065, 351
	未払解約金	2, 615, 114	_	5, 314, 914	1, 154, 019	_	1,801,927
	未払信託報酬	1, 583, 081	1, 491, 321	1, 568, 358	1, 591, 548	1, 578, 622	1, 583, 872
	その他未払費用	3, 587	3, 379	3, 553	3, 609	3, 577	3, 590
(C)	純資産総額(A-B)	2, 018, 495, 445	1, 931, 584, 283	1, 893, 079, 688	1, 943, 940, 261	2, 020, 677, 333	1, 994, 542, 716
	元本	6, 397, 623, 551	6, 392, 151, 564	6, 393, 307, 776	6, 377, 747, 812	6, 355, 660, 899	6, 130, 702, 726
	次期繰越損益金	△4, 379, 128, 106	$\triangle 4,460,567,281$	△4, 500, 228, 088	$\triangle 4, 433, 807, 551$	$\triangle 4,334,983,566$	$\triangle 4, 136, 160, 010$
(D)	受益権総口数	6, 397, 623, 551 □	6, 392, 151, 564□	6, 393, 307, 776□	6, 377, 747, 812 🗆	6, 355, 660, 899 □	6, 130, 702, 726 □
	1万口当たり基準価額(C/D)	3, 155円	3,022円	2,961円	3, 048円	3, 179円	3, 253円

<sup>(</sup>注) 第192期首元本額は6,425,314,482円、第192~197期中追加設定元本額は110,263,622円、第192~197期中一部解約元本額は404,875,378円、 1 口当たり純資産額は、第192期0.3155円、第193期0.3022円、第194期0.2961円、第195期0.3048円、第196期0.3179円、第197期0.3253円です。

# 〇損益の状況

		第192期	第193期	第194期	第195期	第196期	第197期
	項目	2025年1月28日~	2025年2月26日~	2025年3月26日~	2025年4月26日~	2025年5月27日~	2025年6月26日~
		2025年2月25日	2025年3月25日	2025年4月25日	2025年5月26日	2025年6月25日	2025年7月25日
		円	円	円	円	円	円
(A)	配当等収益	12, 171, 368	12, 096, 283	12, 197, 410	12, 307, 262	12, 303, 843	11, 848, 232
	受取配当金	12, 161, 625	12, 083, 828	12, 185, 499	12, 298, 115	12, 293, 459	11, 834, 835
	受取利息	9, 743	12, 455	11, 911	9, 147	10, 384	13, 397
(B)	有価証券売買損益	△ 53, 508, 351	△ 92, 532, 200	△ 45, 937, 649	47, 908, 706	75, 863, 003	37, 979, 691
	売買益	71, 753	60, 949	255, 931	48, 022, 956	76, 034, 483	38, 214, 883
	売買損	△ 53, 580, 104	△ 92, 593, 149	△ 46, 193, 580	△ 114, 250	△ 171,480	△ 235, 192
(C)	信託報酬等	Δ 1, 586, 668	Δ 1, 494, 700	△ 1,571,911	△ 1, 595, 157	Δ 1, 582, 199	Δ 1, 587, 462
(D)	当期損益金(A+B+C)	△ 42, 923, 651	△ 81, 930, 617	Δ 35, 312, 150	58, 620, 811	86, 584, 647	48, 240, 461
(E)	前期繰越損益金	△ 655, 074, 662	△ 695, 120, 447	△ 775, 159, 355	△ 811, 145, 343	△ 752, 315, 505	△ 644, 548, 093
(F)	追加信託差損益金	△3, 677, 930, 982	△3, 680, 320, 142	△3, 686, 559, 930	△3, 678, 094, 146	△3, 666, 074, 878	△3, 536, 787, 027
	(配当等相当額)	(3,940,723,356)	(3,939,121,711)	(3,941,392,668)	(3,931,952,241)	(3,918,582,297)	(3,780,065,305)
	(売買損益相当額)	$(\triangle 7, 618, 654, 338)$	$(\triangle 7, 619, 441, 853)$	$(\triangle 7, 627, 952, 598)$	$(\triangle 7, 610, 046, 387)$	$(\triangle 7, 584, 657, 175)$	$(\triangle 7, 316, 852, 332)$
(G)	計(D+E+F)	△4, 375, 929, 295	△4, 457, 371, 206	△4, 497, 031, 435	△4, 430, 618, 678	△4, 331, 805, 736	△4, 133, 094, 659
(H)	収益分配金	△ 3, 198, 811	△ 3, 196, 075	Δ 3, 196, 653	Δ 3, 188, 873	Δ 3, 177, 830	Δ 3, 065, 351
	次期繰越損益金(G+H)	△4, 379, 128, 106	△4, 460, 567, 281	△4, 500, 228, 088	△4, 433, 807, 551	△4, 334, 983, 566	△4, 136, 160, 010
	追加信託差損益金	$\triangle 3,677,930,982$	△3, 680, 320, 142	$\triangle 3,686,559,930$	△3, 678, 094, 146	△3, 666, 074, 878	$\triangle 3,536,787,027$
	(配当等相当額)	(3,940,723,356)	(3,939,121,711)	(3,941,392,670)	(3,931,952,245)	(3,918,582,297)	( 3, 780, 065, 305)
	(売買損益相当額)	$(\triangle 7, 618, 654, 338)$	$(\triangle 7, 619, 441, 853)$	$(\triangle 7, 627, 952, 600)$	$(\triangle 7, 610, 046, 391)$	$(\triangle 7, 584, 657, 175)$	$(\triangle 7, 316, 852, 332)$
	分配準備積立金	219, 675, 484	225, 241, 916	231, 244, 786	239, 339, 102	247, 197, 030	246, 873, 888
	繰越損益金	△ 920, 872, 608	$\triangle 1,005,489,055$	△1, 044, 912, 944	△ 995, 052, 507	△ 916, 105, 718	△ 846, 246, 871

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

(注)分配金の計算過程(2025年1月28日~2025年7月25日)は以下の通りです。

		第192期	第193期	第194期	第195期	第196期	第197期
	項目	2025年1月28日~ 2025年2月25日	2025年2月26日~ 2025年3月25日		2025年4月26日~ 2025年5月26日		2025年6月26日~ 2025年7月25日
a.	配当等収益(経費控除後)	10, 584, 888円			11, 981, 915円		11, 471, 091円
b.	有価証券売買等損益(経費控除後·繰越欠損金補填後)	0円	0円	0円	0円	0円	0円
с.	信託約款に定める収益調整金	3,940,723,356円	3,939,121,711円	3,941,392,670円	3,931,952,245円	3,918,582,297円	3,780,065,305円
d.	信託約款に定める分配準備積立金	212, 289, 407円	217, 836, 089円	223, 815, 575円	230, 546, 060円	238, 291, 568円	238, 468, 148円
e.	分配対象収益(a+b+c+d)	4, 163, 597, 651円	4, 167, 559, 702円	4, 175, 834, 109円	4, 174, 480, 220円	4, 168, 957, 157円	4,030,004,544円
f.	分配対象収益(1万口当たり)	6,508円	6,519円	6,531円	6,545円	6,559円	6,573円
g.	分配金	3, 198, 811円	3, 196, 075円	3, 196, 653円	3, 188, 873円	3, 177, 830円	3,065,351円
h.	分配金(1万口当たり)	5円	5円	5円	5円	5円	5円

<sup>\*</sup>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。

<sup>\*</sup>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。

#### 〇分配金のお知らせ

	第192期	第193期	第194期	第195期	第196期	第197期
1万口当たり分配金(税込み)	5円	5円	5円	5円	5円	5円

<sup>※</sup>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。

#### 〇お知らせ

「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正に伴い、運用報告書の電子交付に関する 条文を変更する所要の約款変更を行ないました。 <変更適用日:2025年4月1日>

<sup>※</sup>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。

<sup>※</sup>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。

# ノムラ・ケイマン・ハイ・イールド・ファンド JPY Class/USD Class/AUD Class/BRL Class/ TRY Class/Currency Select Class/MXN Class

#### 2024年3月28日決算

#### ●当ファンドの仕組みは次の通りです。

<del></del>	= / · · / · · · = / · · / ·
形態	ケイマン諸島籍円建て外国投資信託
運用方針	米ドル建ての高利回り事業債を主要投資対象とし、インカムゲインの確保に加え、中長期的なキャピタルゲインの獲得を目指します。投資する事業債は、主としてBB+格(S&P社)以下(B-格未満は除く)またはBa1格(Moody's社)以下(B3格未満は除く)の格付が付与されている債券とします。
主要投資対象	米ドル建ての高利回り事業債
受 託 会 社	グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー
投資顧問会社	ノムラ・コーポレート・リサーチ・アンド・アセット・マネージメント・インク
副投資顧問会社	野村アセットマネジメント株式会社
管理事務代行会社 保 管 銀 行	ノムラ・バンク (ルクセンブルグ)エス・エー

<sup>\*</sup>作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに作成いたしております。

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

# 運用計算書 2024年3月28日に終了する計測期間 (米ドル)

<b>収益</b> 銀行口座利息			4,061,971
債券利息(源泉徴収税控除後)			93, 914, 668
収益合計			97, 976, 639
<b>費用</b> 投資顧問報酬			8, 691, 878
管理費用			1, 438, 911
保管費用 取引銀行報酬			639, 789 39, 951
銀行手数料			23, 340
受託報酬			479, 637
法務報酬 海外登記手数料			7, 303 2, 037
専門家報酬			30, 751
雑費用		-	148, 695
費用合計			11, 502, 292
純投資損益			86, 474, 347
投資有価証券売買に係る損益			(13, 682, 518)
外国通貨および為替先渡し契約に係る損益			(19, 813, 127)
当期実現純損益		-	(33, 495, 645)
投資有価証券評価差損益			83, 694, 415
外国為替先渡し契約に係る評価差損益			(13, 459, 469)
当期評価差損益			70, 234, 946
運用の結果による純資産の増減額			123, 213, 648
	1口当たり純資産価格	発行済受益証券数	純資産
JPY Class (in JPY)	4, 974	6, 163, 236	30, 653, 740, 172
USD Class (in JPY)	7, 388	20, 856, 627	154, 095, 329, 586
AUD Class (in JPY)	4, 321	5, 174, 086	22, 355, 003, 051

2,401

1,328

5, 332

10, 429

14, 730, 216

1,722,584

1, 148, 510

230, 731

35, 360, 564, 535

2, 287, 867, 250

6, 124, 292, 350

2, 406, 324, 684

BRL Class (in JPY)

TRY Class (in JPY)

MXN Class (in JPY)

Currency Select Class (in JPY)

## 組入資産明細 2024年3月28日現在 (米ドル)

通貨	数量/額面(1)	銘柄	評価額	純資産比率(%)
		オーストラリア		
普通社債(固				
USD	4, 025, 000	FMG RES AUG 2 6.1250% 15/04/32 144A	3, 980, 559	0. 23
USD	2, 550, 000	MINERAL RESOU 8.5000% 01/05/30 144A	2, 635, 134	0.16
USD	2, 175, 000	FMG RES AUG 2 4.3750% 01/04/31 144A	1, 947, 454	0. 12
USD	1, 500, 000	MINERAL RESOU 9.2500% 01/10/28 144A	1, 581, 351	0.09
USD	550, 000	MINERAL RESOU 8.0000% 01/11/27 144A	562, 348	0.03
USD	450, 000	FMG RES AUG 2 5.8750% 15/04/30 144A	440, 731	0.03
			11, 147, 577	0.66
		オーストラリア計	11, 147, 577	0.66
普通社債(固	(完全到待)	オーストリア		
USD (IE	1, 625, 000	AMS-OSRAM AG 12.2500% 30/03/29 144A	1, 629, 992	0.09
USD	1, 200, 000	BENTELER INT 10.5000% 15/05/28 144A	1, 297, 210	0.08
			2, 927, 202	0. 17
		オーストリア計	2, 927, 202	0. 17
		パミューダ		
普通社債(固		WEATHERDOOD I O 00500/ 00/04/00 1444	E 400 10E	0.45
USD	7, 125, 000	WEATHERFORD I 8. 6250% 30/04/30 144A	7, 429, 137	0. 45
USD	3, 375, 000	NCL CORP 5. 8750% 15/02/27 144A	3, 332, 800	0. 20
USD	2, 750, 000	VALARIS 8. 3750% 30/04/30 144A	2, 829, 574	0. 17
USD	2,000,000	SEADRILL FINA 8. 3750% 01/08/30 144A	2, 093, 378	0. 12
USD	1, 900, 000	VIKING CRUISES LTD 6.25% 15/5/25 14	1, 897, 562	0. 11
USD	1, 275, 000	VIKING CRUISE 5.8750% 15/09/27 144A	1, 251, 190	0. 07
USD	1, 125, 000	NCL CORP 8.3750% 01/02/28 144A	1, 188, 560	0. 07
USD	1, 225, 000	VOC ESCROW LT 5.0000% 15/02/28 144A	1, 178, 466	0. 07
USD	875, 000	NCL CORP 8. 1250% 15/01/29 144A	925, 677	0.06
USD	750, 000	VIKING OCEAN 5.6250% 15/02/29 144A	729, 413	0.04
USD	100, 000	NCL CORP 3.6250% 15/12/24 144A	98, 416	0.01
		バミューダ計	22, 954, 173 22, 954, 173	1. 37 1. 37
			22, 934, 113	1.57
普通社債(固	司定金利債)	英領ヴァージン諸島		
USD	1, 725, 000	STUDIO CITY F 5.0000% 15/01/29 144A	1, 521, 057	0.09
			1, 521, 057	0.09
		英領ヴァージン諸島計	1, 521, 057	0.09
参写礼簿/正	<b>- 一人</b> 到底)	カナダ		
<b>普通社債(固</b> USD	(1) <b>正並利領</b> (1) (1) (1) (1) (1) (1) (1) (1) (1) (1)	1011778 BC UL 4.0000% 15/10/30 144A	6, 014, 846	0.35
USD	5, 075, 000	BOMBARDIER IN 7.8750% 15/04/27 144A	5, 082, 821	0. 33
USD	3, 450, 000	BAYTEX ENERGY 8.5000% 30/04/30 144A	3, 598, 115	0. 23
USD	3, 600, 000	PANTHER BF AG 6. 2500% 15/05/26 144A	3, 597, 952	0. 21
USD	3, 325, 000	BOMBARDIER IN 7. 5000% 01/02/29 144A	3, 426, 273	0. 21
USD	3, 175, 000	PARKLAND CORP 4. 5000% 01/10/29 144A	2, 931, 036	0. 20
USD	3, 025, 000	OPEN TEXT HLD 4. 1250% 01/10/29 144A	2, 646, 156	0.17
USD	2, 200, 000	BAUSCH LOMB 8. 3750% 01/10/28 144A	2, 646, 156	0. 16
USD	2, 200, 000	RITCHIE BROS 7.7500% 15/03/31 144A	2, 125, 885	0. 14
USD	2, 025, 000	GFL ENVIRON I 4. 7500% 15/06/29 144A	2, 125, 885 2, 054, 119	0. 13
				0. 12
	1 075 000			
USD	1, 975, 000	NOVA CHEMICAL 9.0000% 15/02/30 144A	2, 032, 771	
	1, 975, 000 2, 225, 000 1, 975, 000	NOVA CHEMICAL 9.0000% 15/02/30 144A VIDEOTRON LTD 3.6250% 15/06/29 144A VIDEOTRON LTD 5.1250% 15/04/27 144A	2, 032, 771 2, 008, 924 1, 934, 599	0. 12 0. 12 0. 12

通貨	数量/額面(1)	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	1,825,000	ONTARIO GAMI/ 8.0000% 01/08/30 144A	1, 879, 729	0.11
USD	1, 800, 000	ENERFLEX LTD 9.0000% 15/10/27 144A	1, 844, 518	0. 11
USD	2,000,000	IAMGOLD CORP 5. 7500% 15/10/28 144A	1, 838, 343	0. 11
USD	1,800,000	MASONITE INTL 5. 3750% 01/02/28 144A	1, 802, 909	0. 11
USD	2,000,000	OPEN TEXT HLD 4. 1250% 15/02/30 144A	1, 789, 871	0. 11
USD	1, 925, 000	GFL ENVIRON I 4.0000% 01/08/28 144A	1, 767, 706	0. 11
USD	1, 875, 000	NOVA CHEMICALS CORP 5. 25% 01/06/27	1, 764, 544	0.11
USD	1, 925, 000	MATTAMY GROUP 4. 6250% 01/03/30 144A	1, 746, 532	0.10
USD	1,700,000	PARKLAND CORP 5. 8750% 15/07/27 144A	1, 684, 125	0.10
USD	1,600,000	GOEASY LTD 7.6250% 01/07/29 144A	1, 602, 142	0.10
USD	1,625,000	TEINE ENERGY 6.8750% 15/04/29 144A	1, 580, 634	0.09
USD	1,675,000	1011778 BC UL 4.3750% 15/01/28 144A	1, 579, 675	0.09
USD	1, 375, 000	NOVA CHEMICAL 8. 5000% 15/11/28 144A	1, 462, 667	0.09
USD	1, 458, 000	PRECISION DRI 6. 8750% 15/01/29 144A	1, 453, 028	0.09
USD	1, 475, 000	BOMBARDIER IN 6. 0000% 15/02/28 144A	1, 451, 869	0.09
USD	1, 350, 000	BOMBARDIER IN 7. 1250% 15/06/26 144A	1, 369, 441	0.08
USD	1, 324, 000	TASEKO MINES 7.0000% 15/02/26 144A	1, 327, 975	0.08
USD	1, 375, 000	OPEN TEXT COR 3. 8750% 01/12/29 144A	1, 223, 311	0. 07
USD	1, 250, 000	GARDA SECURIT 4.6250% 15/02/27 144A	1, 195, 282	0.07
USD	1, 250, 000	SUPERIOR PLUS 4. 5000% 15/03/29 144A	1, 156, 295	0.07
USD	1, 100, 000	GFL ENVIRON I 6. 7500% 15/01/31 144A	1, 126, 340	0.07
USD	1, 225, 000	BROOKFIELD RE 5. 0000% 15/06/29 144A	1, 111, 732	0. 07
USD	1, 225, 000	BROOKFIELD RE 4.8750% 15/02/30 144A	1, 096, 275	0.07
USD	1, 125, 000	VERMILION ENE 6.8750% 01/05/30 144A	1, 095, 844	0.07
USD	1, 050, 000	TRANSALTA CORP 7.7500% 15/11/29	1, 092, 260	0.07
USD	1, 100, 000	HUDBAY MINERA 6. 1250% 01/04/29 144A	1, 087, 014	0.06
USD	1, 050, 000	MEG ENERGY CO 5.8750% 01/02/29 144A	1, 029, 911	0.06
USD	1, 050, 000	AIR CANADA 3.8750% 15/08/26 144A	998, 869	0.06
USD	975, 000	CLARIOS GLOBA 8.5000% 15/05/27 144A	975, 227	0.06
USD	1, 100, 000	MASONITE INTL 3.5000% 15/02/30 144A	972, 570	0.06
USD	900, 000	BOMBARDIER IN 8.7500% 15/11/30 144A	961, 793	0.06
USD	925, 000	PARKLAND CORP 4.6250% 01/05/30 144A	852, 240	0.05
USD	800,000	HUSKY IN / TI 9.0000% 15/02/29 144A	827, 020	0.05
USD	850, 000	HUDBAY MINERA 4.5000% 01/04/26 144A	823, 967	0.05
USD	775, 000	BOMBARDIER IN 7.2500% 01/07/31 144A	777, 943	0.05
USD	725, 000	GARDA SECURIT 7.7500% 15/02/28 144A	739, 557	0.04
USD	1, 250, 000	TELESAT CANAD 4.8750% 01/06/27 144A	700, 000	0.04
USD	700, 000	NOVA CHEMICAL 4. 2500% 15/05/29 144A	598, 411	0.04
USD	875, 000	BAUSCH HEALTH 6.1250% 01/02/27 144A	544, 688	0.03
USD	475, 000	OPEN TEXT COR 6.9000% 01/12/27 144A	491, 600	0.03
USD	700, 000	BAUSCH HEALTH 5.7500% 15/08/27 144A	403, 634	0.02
USD	650, 000	TELESAT CANAD 5.6250% 06/12/26 144A	387, 231	0.02
USD	350, 000	RITCHIE BROS 6.7500% 15/03/28 144A	357, 018	0.02
USD	275, 000	OPEN TEXT COR 3.8750% 15/02/28 144A	254, 932	0.02
USD	575, 000	TELESAT CANAD 6.5000% 15/10/27 144A	244, 375	0.01
			90, 795, 604	5. 41
		カナダ計	90, 795, 604	5. 41
		ケイマン諸島		
その他債券				
USD	6, 537, 027	GLB AIR LEASE CO PIK 15/09/24 144A	6, 186, 174	0.37
USD	4, 475, 000	TRANSOCEAN IN 8.7500% 15/02/30 144A	4, 194, 992	0.25
USD	1,500,000	TRANSOCEAN PO 6.8750% 01/02/27 144A	1, 012, 533	0.06
			11, 393, 699	0.68
	固定金利債)			
USD	5, 325, 000	SHELF DRL HOL 9.6250% 15/04/29 144A	5, 148, 509	0.30
USD	2, 800, 000	MGM CHINA HOL 4.7500% 01/02/27 144A	2, 666, 161	0.15
USD	2, 725, 000	WYNN MACAU LT 5. 1250% 15/12/29 144A	2, 483, 054	0. 15
USD	1, 583, 625	SEAGATE HDD CAYM 9.6250% 01/12/32	1, 803, 238	0.11
USD	1,650,000	TRANSOCEAN TI 8.3750% 01/02/28 144A	1, 715, 786	0.10
USD	1, 800, 000	MELCO RESORTS 5.3750% 04/12/29 144A	1, 636, 697	0. 10
USD	1, 150, 000	CARLYLE AVIAT 7.0000% 15/10/24 144A	1, 140, 317	0.07

通貨	数量/額面(1)	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	1, 250, 000	SEAGATE HDD CAYM 4.1250% 15/01/31	1, 100, 988	0.07
USD	450,000	GGAM FINANCE 6.8750% 15/04/29 144A	451, 463	0.03
USD	300,000	DIAMOND FRGN/ 8.5000% 01/10/30 144A	316, 448	0.02
USD	225, 000	WYNN MACAU LT 5.5000% 01/10/27 144A	215, 314	0. 01
	,		18, 677, 975	1.11
		ケイマン諸島計	30, 071, 674	1. 79
		フランス		
<b>変動金利債</b> USD	1,000,000	ELEC DE FRANCE FRN 31/12/72 144A	1, 099, 840	0.07
USD	1,000,000	ELEC DE PRANCE PRIN 31/12/12 144A	1, 099, 840	0.07
普通社債(固		11 TYON DD 11 OF 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10	E 100 10E	
USD	6, 575, 000	ALTICE FRANCE 8. 1250% 01/02/27 144A	5, 186, 435	0.31
USD	3, 950, 000	ILIAD HOLDING 7.0000% 15/10/28 144A	3, 908, 992	0.23
USD	3, 400, 000	ALTICE FRANCE 5.5000% 15/01/28 144A	2, 475, 414	0. 15
USD	3, 325, 000	ALTICE FRANCE 5.1250% 15/07/29 144A	2, 280, 114	0.14
USD	2,800,000	ALTICE FRANCE 5.5000% 15/10/29 144A	1, 922, 325	0.11
USD	2,000,000	CONSTELLIUM S 3.7500% 15/04/29 144A	1, 795, 275	0.11
USD	1, 750, 000	CONSTELLIUM S 5. 6250% 15/06/28 144A	1, 703, 779	0. 10
USD	1,650,000	ILIAD HOLDING 6. 5000% 15/10/26 144A	1, 632, 117	0.10
USD	600,000	SNF GROUP SAC 3. 1250% 15/03/27 144A	553, 308	0. 10
USD	600,000	SNF GROUP SAC 3. 3750% 15/03/30 144A	518, 959	0.03
		SNF GROUP SAC 3.3750% 15/03/30 144A		
USD	600,000	ALTICE FRANCE 5.1250% 15/01/29 144A	418, 850	0.02
			22, 395, 568	1. 33
		フランス計	23, 495, 408	1. 40
普通社債(固)	中央刊傳(	アイルランド		
USD USD	3, 600, 000	ARDAGH PKG FI 4.1250% 15/08/26 144A	3, 265, 833	0. 20
USD	2,000,000	ARDAGH PKG FI 5. 2500% 30/04/25 144A	1, 934, 287	0. 12
USD	1,700,000	JAZZ SECURITI 4. 3750% 15/01/29 144A		0. 12
			1, 583, 106	
USD	600,000	VIRGIN MEDIA 5.0000% 15/07/28 144A	549, 086	0.03
USD	425, 000	CASTLELAKE AV 5.0000% 15/04/27 144A	409, 177	0.02
USD	400, 000	MOTION BONDCO 6.6250% 15/11/27 144A	386, 550	0.02
			8, 128, 039	0.48
		アイルランド計	8, 128, 039	0.48
		イタリア		
亦制心利度		1777		
<b>変動金利債</b> USD	2, 250, 000	INTESA SANPAOLO FRN 01/06/42	1, 675, 941	0. 10
		INTESA SANPAOLO FRN 01/06/42		
USD	2, 250, 000 775, 000		727, 800	0.04
USD		INTESA SANPAOLO FRN 01/06/42 UNICREDIT SPA FRN 30/06/35 144A	727, 800 2, 403, 741	0. 04 0. 14
USD		INTESA SANPAOLO FRN 01/06/42 UNICREDIT SPA FRN 30/06/35 144A イタリア計	727, 800	0. 04 0. 14
USD	775, 000	INTESA SANPAOLO FRN 01/06/42 UNICREDIT SPA FRN 30/06/35 144A	727, 800 2, 403, 741	0. 04 0. 14
USD USD	775, 000	INTESA SANPAOLO FRN 01/06/42 UNICREDIT SPA FRN 30/06/35 144A イタリア計	727, 800 2, 403, 741 2, 403, 741 1, 483, 276	0. 04 0. 14 0. 14
USD USD 普通社債(固	775,000	INTESA SANPAOLO FRN 01/06/42 UNICREDIT SPA FRN 30/06/35 144A イタリア計	727, 800 2, 403, 741 2, 403, 741	0. 04 0. 14 0. 14
USD USD 普通社債(固	775,000	INTESA SANPAOLO FRN 01/06/42 UNICREDIT SPA FRN 30/06/35 144A イタリア計	727, 800 2, 403, 741 2, 403, 741 1, 483, 276	0. 10 0. 04 0. 14 0. 14 0. 09 0. 09 0. 09
USD USD 普通社債(固) USD	775,000 定金利債) 1,400,000	INTESA SANPAOLO FRN 01/06/42 UNICREDIT SPA FRN 30/06/35 144A イタリア計 <b>日本</b> RAKUTEN GROU 11.2500% 15/02/27 144A	727, 800 2, 403, 741 2, 403, 741 1, 483, 276 1, 483, 276	0. 04 0. 14 0. 14 0. 09 0. 09
USD USD 普通社債(固) USD	775,000 定金利債) 1,400,000 定金利債)	INTESA SANPAOLO FRN 01/06/42 UNICREDIT SPA FRN 30/06/35 144A イタリア計 日本 RAKUTEN GROU 11.2500% 15/02/27 144A 日本計 ジャージー	727, 800 2, 403, 741 2, 403, 741 1, 483, 276 1, 483, 276 1, 483, 276	0. 04 0. 14 0. 14 0. 09 0. 09 0. 09
USD USD 普通社債(固 USD	<b>定金利債)</b> 1,400,000 <b>定金利債)</b> 3,100,000	INTESA SANPAOLO FRN 01/06/42 UNICREDIT SPA FRN 30/06/35 144A イタリア計 日本 RAKUTEN GROU 11.2500% 15/02/27 144A 日本計 ジャージー ADIENT GLOBAL 4.8750% 15/08/26 144A	727, 800 2, 403, 741 2, 403, 741 1, 483, 276 1, 483, 276 1, 483, 276 3, 028, 251	0. 04 0. 14 0. 14 0. 09 0. 09 0. 09 0. 09
世通社債(固 USD) 世通社債(固 USD) USD	<b>定金利債)</b> 1,400,000 <b>定金利債)</b> 3,100,000 1,450,000	INTESA SANPAOLO FRN 01/06/42 UNICREDIT SPA FRN 30/06/35 144A イタリア計 日本 RAKUTEN GROU 11.2500% 15/02/27 144A 日本計 ジャージー ADIENT GLOBAL 4.8750% 15/08/26 144A ADIENT GLOBAL 8.2500% 15/04/31 144A	727, 800 2, 403, 741 2, 403, 741 2, 403, 741 1, 483, 276 1, 483, 276 1, 483, 276 1, 483, 276 1, 483, 276	0. 04 0. 14 0. 14 0. 09 0. 09 0. 09 0. 18 0. 09
普通社債(固 USD 普通社債(固 USD USD USD USD USD	<b>定金利債)</b> 1,400,000 <b>定金利債)</b> 3,100,000 1,450,000 875,000	INTESA SANPAOLO FRN 01/06/42 UNICREDIT SPA FRN 30/06/35 144A イタリア計 日本 RAKUTEN GROU 11.2500% 15/02/27 144A 日本計 ジャージー ADIENT GLOBAL 4.8750% 15/08/26 144A ADIENT GLOBAL 8.2500% 15/04/31 144A ADIENT GLOBAL 7.0000% 15/04/28 144A	727, 800 2, 403, 741 2, 403, 741 1, 483, 276 1, 483, 276 1, 483, 276 1, 483, 276 1, 483, 276 1, 483, 276	0. 04 0. 14 0. 14 0. 09 0. 09 0. 09 0. 09 0. 18 0. 09 0. 09 0. 09
世通社債(固 USD) 世通社債(固 USD) USD	<b>定金利債)</b> 1,400,000 <b>定金利債)</b> 3,100,000 1,450,000	INTESA SANPAOLO FRN 01/06/42 UNICREDIT SPA FRN 30/06/35 144A イタリア計 日本 RAKUTEN GROU 11.2500% 15/02/27 144A 日本計 ジャージー ADIENT GLOBAL 4.8750% 15/08/26 144A ADIENT GLOBAL 8.2500% 15/04/31 144A	727, 800 2, 403, 741 2, 403, 741 2, 403, 741 1, 483, 276 1, 483, 276 1, 483, 276 1, 483, 276 1, 531, 619 893, 341 814, 000	0. 04 0. 14 0. 14 0. 09 0. 09 0. 09 0. 09 0. 09 0. 09 0. 09 0. 09
世通社債(固 USD 普通社債(固 USD USD USD USD USD	<b>定金利債)</b> 1,400,000 <b>定金利債)</b> 3,100,000 1,450,000 875,000	INTESA SANPAOLO FRN 01/06/42 UNICREDIT SPA FRN 30/06/35 144A イタリア計 日本 RAKUTEN GROU 11.2500% 15/02/27 144A 日本計 ジャージー ADIENT GLOBAL 4.8750% 15/08/26 144A ADIENT GLOBAL 8.2500% 15/04/31 144A ADIENT GLOBAL 7.0000% 15/04/28 144A	727, 800 2, 403, 741 2, 403, 741 1, 483, 276 1, 483, 276 1, 483, 276 1, 483, 276 1, 483, 276 1, 483, 276	0. 04 0. 14 0. 14 0. 09 0. 09 0. 09 0. 18 0. 09

通貨	数量/額面(1)	銘柄	評価額	純資産比率(%)
		リベリア		
普通社債(固	記定金利債)			
USD	5, 475, 000	ROYAL CARIBBE 5.5000% 01/04/28 144A	5, 410, 729	0.31
USD	4, 350, 000	ROYAL CARIBBE 5.3750% 15/07/27 144A	4, 282, 039	0. 26
USD	3, 275, 000	ROYAL CARIBBEAN 7.5000% 15/10/27	3, 447, 317	0. 21
USD	2,075,000	ROYAL CARIBBEAN 3.7000% 15/03/28	1, 926, 408	0.11
USD	1, 525, 000	ROYAL CARIBBE 8. 2500% 15/01/29 144A	1, 614, 591	0.10
USD	825, 000	ROYAL CARIBBE 6. 2500% 15/03/32 144A	831, 608	0.05
USD	775, 000	ROYAL CARIBBE 5.5000% 31/08/26 144A	767, 576	0.05
USD	600,000	ROYAL CARIBBE 7. 2500% 15/01/30 144A	622, 663	0.04
			18, 902, 931	1. 13
		リベリア計	18, 902, 931	1. 13
**********	Table A. Tal Mr.	ルクセンブルグ		
普通社債(固		ALTICE FINANC F 75000/ 15/00/90 1444	2 450 220	0, 20
USD	4, 300, 000	ALTICE FINANC 5. 7500% 15/08/29 144A	3, 456, 339	
USD	3, 700, 000	TELECOM ITALIA CAP 6% 30/09/34	3, 377, 184	0. 20
USD	3, 200, 000	ALTICE FINANC 5. 0000% 15/01/28 144A	2, 650, 939	0. 16
USD	2, 400, 000	CONNECT FINCO 6.7500% 01/10/26 144A	2, 355, 097	0. 14
USD	2,000,000	ALTICE FINANC 9. 6250% 15/07/27 144A	1, 945, 639	0. 12
USD	1, 925, 000	TELECOM IT CAP 6.3750% 15/11/33	1, 813, 628	0. 11
USD	1, 875, 000	CONS ENERGY F 5.6250% 15/10/28 144A	1, 566, 008	0.09
USD	800,000	STENA INTERNA 7.2500% 15/01/31 144A	797, 652	0.05
USD	678, 000	TR OP / TR FI 5.3750% 01/09/25 144A	536, 758	0.03
USD	500,000	STENA INTERNA 7.6250% 15/02/31 144A	505, 706	0.03
USD	308, 000	CONS ENERGY F 6.5000% 15/05/26 144A	286, 942	0.02
			19, 291, 892	1. 15
		ルクセンブルグ計	19, 291, 892	1. 15
*****	- 一人では、	マルタ		
普通社債(I USD	可定金利債) 1,700,000	VICTA ICT MAI T 7 97500/ 01/05/97 1444	1 424 905	0.09
USD	1, 700, 000	VISTAJET MALT 7.8750% 01/05/27 144A	1, 434, 205	
			1, 434, 205	0.09
		マルタ計	1, 434, 205	0.09
普通社債(固	ラウム 利佐 \	マーシャル諸島		
百 <b>週社頃(E</b> USD	3, 200, 000	SEASPAN CORP 5.5000% 01/08/29 144A	2, 803, 912	0.17
	, ,		2, 803, 912	0. 17
		マーシャル諸島計	2, 803, 912	0.17
		メキシコ		
変動金利債	800,000	CEMEY CAD EDN 09/00/00 1444	770 979	0.05
USD	800, 000	CEMEX SAB FRN 08/09/69 144A	772, 373 772, 373	0.05
普通社債(固	記定金利債)		112,010	0.00
USD	1,000,000	CEMEX SAB 5.2000% 17/09/30 144A	966, 092	0.06
USD	800,000	CEMEX SAB 3.8750% 11/07/31 144A	708, 272	0.04
			1, 674, 364	0.10
		メキシコ計	2, 446, 737	0.15
		オランダ		
普通社債(固		FIGGO 2 20000/ 15/01/05 1444	0.510.050	0.00
USD	3, 778, 000	ZIGGO 6.0000% 15/01/27 144A	3, 719, 259	0. 23
USD	3, 375, 000	ALCOA NEDERLA 6. 1250% 15/05/28 144A	3, 381, 944	0. 20
USD	2, 475, 000	SENSATA TECH 4.0000% 15/04/29 144A	2, 258, 161	0. 13
USD	2, 450, 000	SUNRISE FINCO 4. 8750% 15/07/31 144A	2, 187, 556	0. 13
USD	2, 200, 000	SUNRISE HOLDC 5. 5000% 15/01/28 144A	2, 112, 000	0. 13
USD	1, 625, 000	SENSATA TECH 4. 3750% 15/02/30 144A	1, 471, 925	0.09
USD	1,000,000	ALCOA NEDERLA 7. 1250% 15/03/31 144A	1, 020, 562	0.06
USD	1,000,000	ZIGGO BV 4.8750% 15/01/30 144A	893, 693	0.05

通貨	数量/額面(1)	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	925, 000	OI EUROPEAN G 4.7500% 15/02/30 144A	851, 815	0.05
USD	825, 000	ELASTIC NV 4.1250% 15/07/29 144A	742, 677	0.04
USD	800, 000	ZIGGO 5. 1250% 28/02/30 144A	683, 452	0.04
USD	600, 000	AXALTA COATIN 7. 2500% 15/02/31 144A	623, 075	0.04
USD	600, 000	SENSATA TECH 5.8750% 01/09/30 144A	587, 245	0.03
		. t. = v . W=1	20, 533, 364	1. 22
		オランダ計	20, 533, 364	1. 22
****	<b>一人</b> 到底\	パナマ		
普通社債(固) USD	<b>连並利慎)</b> 7,650,000	CARNIVAL CORP 5. 7500% 01/03/27 144A	7, 556, 253	0.45
USD	6, 875, 000	CARNIVAL CORP 7. 6250% 01/03/26 144A	6, 959, 789	0.41
USD	6, 250, 000	CARNIVAL CORP 6. 0000% 01/05/29 144A	6, 170, 531	0. 37
USD	4, 925, 000	CARNIVAL COR 10. 5000% 01/06/30 144A	5, 386, 345	0. 32
USD	2, 250, 000	CARNIVAL CORP 4. 0000% 01/08/28 144A	2, 091, 437	0. 12
USD	575, 000	CARNIVAL CORP 7.0000% 15/08/29 144A	599, 596	0.04
			28, 763, 951	1.71
		パナマ計	28, 763, 951	1.71
		スイス		
<b>普通社債(固)</b> USD	<b>定金利債)</b> 700,000	TRANSOCEAN ACUIL 8 00009/ 20/00/29	718, 071	0.04
USD	700,000	TRANSOCEAN AQUIL 8.0000% 30/09/28	718, 071	0.04
		スイス計	718, 071	0.04
		<b>人 1 人 計</b>	118,071	0.04
変動金利債		イギリス		
<b>変動並作順</b> USD	4, 225, 000	VODAFONE GROUP FRN 04/04/79	4, 364, 201	0. 26
USD	800,000	BARCLAYS PLC FRN 31/12/72	848, 243	0.05
USD	800,000	BARCLAYS PLC FRN 31/12/72	797, 786	0.05
USD	400,000	BARCLAYS PLC FRN 15/12/69	385, 758	0.02
USD	200, 000	BARCLAYS PLC FRN 31/12/73	199, 540 6, 595, 528	0.01
普通社債(固)	定金利債)		0, 595, 528	0.39
USD	2, 925, 000	ITHACA ENERGY 9.0000% 15/07/26 144A	2, 951, 321	0.19
USD	3, 400, 000	VMED O2 UK FI 4.2500% 31/01/31 144A	2, 862, 564	0.18
USD	2, 400, 000	JAGUAR LAND R 7.7500% 15/10/25 144A	2, 423, 866	0.14
USD	2, 500, 000	INTL GAME TEC 5. 2500% 15/01/29 144A	2, 417, 106	0. 14
USD	1, 800, 000	GLOBAL AUTO/A 8. 3750% 15/01/29 144A	1, 748, 396	0. 10
USD	1,800,000	GLOBAL AUTO/A 8.7500% 15/01/32 144A	1, 740, 918	0. 10
USD	1,600,000	JAGUAR LAND R 5. 8750% 15/01/28 144A	1, 574, 831	0.09
USD USD	1, 400, 000 1, 600, 000	MERLIN ENTERT 5.7500% 15/06/26 144A VMED O2 UK FI 4.7500% 15/07/31 144A	1, 386, 320 1, 374, 442	0. 08 0. 08
USD	1,600,000	VIRGIN MEDIA 5. 0000% 15/07/30 144A	1, 363, 859	0.08
USD	1, 400, 000	VIRGIN MEDIA 5. 5000 % 15/01/30 144A VIRGIN MEDIA 5. 5000 % 15/05/29 144A	1, 290, 350	0.08
USD	1, 200, 000	JAGUAR LAND R 5. 5000% 15/07/29 144A	1, 157, 278	0. 07
USD	1, 075, 000	INTL GAME TEC 4. 1250% 15/04/26 144A	1, 042, 535	0.06
USD	700,000	MACQUARIE AIR 8. 3750% 01/05/28 144A	742, 627	0.04
USD	675, 000	MACQUARIE AIR 8. 1250% 30/03/29 144A	713, 661	0.04
USD	625,000	MACQUARIE AIR 6.5000% 26/03/31 144A	635, 938	0.04
USD	425,000	MACQUARIE AIR 6. 4000% 26/03/29 144A	431, 634	0.03
			25, 857, 646	1.54
		イギリス計	32, 453, 174	1.93
		アメリカ		
<b>変動金利債</b> USD	5, 850, 000	ILFC E-CAP TRUST FRN 21/12/65 144A	4, 563, 000	0. 26
USD	1, 150, 000	VISTRA CORP FRN 31/12/70 144A	1, 138, 580	0. 20
	1, 100, 000	BANK OF AMERICA FRN 29/12/49 DD	1. 102. 257	0. 07
USD USD	1, 100, 000 1, 025, 000	BANK OF AMERICA FRN 29/12/49 DD NRG ENERGY INC FRN 31/12/72 144A	1, 102, 257 1, 098, 654	0. 07 0. 07

通貨	数量/額面(1)	銘柄	評価額	純資産比率(%)
普通株				
	58, 449	CORNERSTONE CHEM CO	1, 110, 531	0.06
	63, 336	DHL CLASS A	114, 638	0.01
この 山 唐 巻			1, 225, 169	0.07
その他債券 USD	5, 175, 000	AMERICAN AIRL 5.5000% 20/04/26 144A	3, 855, 946	0. 22
USD	3, 725, 000	AMERICAN AIRL 5.7500% 20/04/29 144A	3, 657, 395	0. 22
USD	1, 350, 000	DELTA/SKYMILE 4.7500% 20/10/28 144A	1, 323, 558	0.08
USD	685, 011	DELTA/SKYMILE 4.5000% 20/10/25 144A	592, 513	0.04
普通社債(固	記定金利債)		9, 429, 412	0. 56
USD	9, 475, 000	TRANSDIGM INC 5.5000% 15/11/27	9, 265, 988	0.54
USD	7, 900, 000	MEDLINE BORRO 3.8750% 01/04/29 144A	7, 198, 650	0.42
USD	7, 550, 000	CLD SFTWR GRP 6.5000% 31/03/29 144A	7, 140, 251	0.42
USD	6, 825, 000	SPRINGLEAF FIN 7. 1250% 15/03/26	6, 948, 504	0.41
USD	5, 700, 000	OLYMPUS WTR H 9.7500% 15/11/28 144A	6, 070, 510	0. 36
USD	6, 400, 000	CCO HOLDINGS 6. 3750% 01/09/29 144A	6, 064, 864	0. 36
USD	6,000,000	FORD MOTOR CREDIT 5.1130% 03/05/29	5, 825, 577	0. 35
USD	6, 250, 000	CAESARS ENT 4.6250% 15/10/29 144A	5, 723, 532	0. 34
USD USD	5, 625, 000 5, 350, 000	WYNN LAS VEGAS 5.25% 15/05/27 144A FORD MOTOR CO 6.1000% 19/08/32	5, 513, 571 5, 414, 187	0. 33 0. 32
USD	5, 400, 000	STAPLES INC 7. 5000% 15/04/26 144A	5, 265, 030	0. 32
USD	5, 350, 000	PRIME SEC/FIN 6. 2500% 15/01/28 144A	5, 244, 755	0.31
USD	5, 050, 000	VENTURE GLOBA 8. 1250% 01/06/28 144A	5, 155, 597	0.31
USD	5, 425, 000	DIRECTV FIN/D 5. 8750% 15/08/27 144A	5, 124, 188	0. 31
USD	5, 175, 000	TENET HEALTHCARE 5. 1250% 01/11/27	5, 055, 898	0.30
USD	6, 275, 000	CCO HOLDINGS 4.5000% 01/05/32	5, 035, 249	0.30
USD	5, 250, 000	UBER TECHNOLO 4.5000% 15/08/29 144A	4, 977, 313	0.30
USD	5, 275, 000	IMOLA MERGER 4.7500% 15/05/29 144A	4, 958, 522	0.30
USD	5, 900, 000	CCO HOLDINGS 4.2500% 01/02/31 144A	4, 805, 538	0. 29
USD	4, 800, 000	TENET HEALTHCARE 6.1250% 15/06/30	4, 788, 012	0. 29
USD	4, 800, 000	TENET HEALTHCARE 6. 1250% 01/10/28	4, 785, 515	0. 29
USD	4, 767, 000	UBER TECHNOLO 6. 2500% 15/01/28 144A	4, 784, 590	0. 29
USD	4, 500, 000	VENTURE GLOBA 8. 3750% 01/06/31 144A	4, 635, 342	0. 28
USD	4, 525, 000	LIFE TIME INC 5. 7500% 15/01/26 144A	4, 490, 999	0. 27
USD USD	4, 662, 000 4, 459, 000	SIRIUS XM RAD 5.0000% 01/08/27 144A MGM RESORTS 5.7500% 15/06/25	4, 479, 750 4, 451, 017	0. 27 0. 27
USD	4, 350, 000	EQM MIDSTREAM 6. 5000% 01/07/27 144A	4, 393, 552	0. 27
USD	4, 800, 000	IRON MTN INFO 5. 0000% 15/07/32 144A	4, 381, 782	0. 26
USD	4, 375, 000	UNIVISION COM 7. 3750% 30/06/30 144A	4, 321, 705	0. 26
USD	4, 775, 000	STANDARD INDS 4. 3750% 15/07/30 144A	4, 285, 648	0. 26
USD	4, 720, 000	OLYMPUS WTR H 4.2500% 01/10/28 144A	4, 277, 880	0. 25
USD	3, 925, 000	VENTURE GLOBA 9.5000% 01/02/29 144A	4, 231, 966	0.25
USD	4, 200, 000	WASH MULT ACQ 5.7500% 15/04/26 144A	4, 122, 680	0. 25
USD	4, 125, 000	TENET HEALTHCARE 6.2500% 01/02/27	4, 120, 328	0. 25
USD	4, 025, 000	DISH NETWORK 11.7500% 15/11/27 144A	4, 116, 186	0. 25
USD	4, 100, 000	CITGO PETROLE 7.0000% 15/06/25 144A	4, 096, 627	0. 24
USD	4, 050, 000	ENDEAVOR ENER 5. 7500% 30/01/28 144A	4, 080, 565	0. 24
USD	4, 150, 000	NEWELL RUBBERMAID INC 4.2% 01/04/26	4, 067, 925	0. 24
USD	4, 525, 000	BUILDERS FIRS 4. 2500% 01/02/32 144A	4, 046, 152	0. 24
USD USD	4, 275, 000 4, 800, 000	NEPTUNE BIDCO 9. 2900% 15/04/29 144A CCO HOLDINGS 4. 5000% 15/08/30 144A	4, 042, 022 4, 031, 437	0. 24 0. 24
USD	4, 250, 000	CQP HOLDCO LP/BI 5.5000% 15/06/31	4, 019, 293	0. 24
USD	4, 325, 000	UNITED AIRLIN 4. 6250% 15/04/29 144A	4, 019, 293	0. 24
USD	4, 300, 000	TRANSDIGM INC 4. 8750% 01/05/29 WI	4, 005, 578	0. 24
USD	3, 800, 000	BOOST NEWCO B 7. 5000% 15/01/31 144A	3, 977, 764	0. 24
USD	3, 925, 000	SPRINGLEAF FINANCE 6. 8750% 15/03/25	3, 965, 675	0. 24
USD	4, 025, 000	PBF HOLDING CO 6. 0000% 15/02/28	3, 960, 357	0. 24
USD	4, 150, 000	CLEARWAY ENER 4.7500% 15/03/28 144A	3, 928, 900	0.23
USD	4, 275, 000	CHS/COMMUNITY 5.6250% 15/03/27 144A	3, 926, 160	0. 23
USD	3, 625, 000	VENTURE GLOBA 9.8750% 01/02/32 144A	3, 900, 119	0.23
USD	3, 975, 000	BRISTOW GROUP 6.8750% 01/03/28 144A	3, 882, 279	0. 23

通貨	数量/額面(1)	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	4, 050, 000	CHEMOURS CO 5.7500% 15/11/28 144A	3, 771, 100	0. 22
USD	4, 890, 000			0. 22
		MPT OP PTNR/FINL 4. 6250% 01/08/29	3, 762, 290	
USD	3, 739, 000	OWENS-BROCKWA 6. 6250% 13/05/27 144A	3, 740, 125	0. 22
USD	3, 675, 000	NAVIENT CORP 6. 7500% 15/06/26	3, 701, 813	0. 22
USD	3, 575, 000	TRANSDIGM INC 6. 7500% 15/08/28 144A	3, 627, 649	0. 22
USD	3, 815, 000	CINEMARK USA 5. 2500% 15/07/28 144A	3, 605, 686	0. 21
USD	4, 025, 000	DAVITA INC 4. 6250% 01/06/30 144A	3, 599, 566	0. 21
USD	3, 750, 000	LIVE NATION E 4.7500% 15/10/27 144A	3, 578, 750	0. 21
USD	3, 425, 000	UNITI / CSL 10.5000% 15/02/28 144A	3, 538, 686	0. 21
USD	4,000,000	ORGANON & CO/ 5. 1250% 30/04/31 144A	3, 521, 934	0. 21
USD	4, 125, 000	MATCH GROUP I 3.6250% 01/10/31 144A	3, 507, 993	0. 21
USD	3, 575, 000	SRM ESCROW IS 6.0000% 01/11/28 144A	3, 494, 282	0. 21
USD	3, 750, 000	ICAHN ENTERP/FINANCE 5.25% 15/05/27	3, 474, 369	0. 21
USD	3, 525, 000	ENLINK MIDSTREA 5.3750% 01/06/29	3, 456, 361	0. 21
USD	3, 475, 000	DARLING INGRE 6.0000% 15/06/30 144A	3, 441, 931	0. 21
USD	3, 625, 000	CALPINE CORP 4.5000% 15/02/28 144A	3, 428, 996	0. 20
USD	3, 750, 000	ASHTON WOODS 4.6250% 01/04/30 144A	3, 420, 093	0. 20
USD	3, 275, 000	BALL CORP 6.0000% 15/06/29	3, 303, 725	0.20
USD	3, 425, 000	SEAWORLD PARK 5. 2500% 15/08/29 144A	3, 214, 886	0.19
USD	3, 225, 000	RADIAN GROUP INC 4.5000% 01/10/24	3, 193, 882	0.19
USD	3, 050, 000	VISTRA OPERAT 7.7500% 15/10/31 144A	3, 188, 659	0. 19
USD	3, 425, 000	NAVIENT CORP 5. 5000% 15/03/29	3, 177, 202	0. 19
USD	3, 350, 000	SCIH SALT HOL 4. 8750% 01/05/28 144A	3, 124, 177	0. 19
USD	3, 125, 000	SM ENERGY CO 6.75% 15/09/26	3, 123, 870	0. 19
USD	3, 300, 000	AFFINITY INTE 6. 8750% 15/12/27 144A	3, 083, 051	0. 13
USD	3, 225, 000	US FOODS INC 4.7500% 15/02/29 144A	3, 059, 910	0. 18
USD	3, 125, 000	OUTFRONT MEDI 5. 0000% 15/08/27 144A	3, 009, 661	0. 18
			3, 008, 999	0. 18
USD	3, 175, 000	AVANTOR FUNDI 4. 6250% 15/07/28 144A		
USD	3, 225, 000	TRANSDIGM INC 4. 6250% 15/01/29 WI	2, 996, 142	0. 18
USD	2,991,000	MATADOR RESOURC 5. 8750% 15/09/26 WI	2, 992, 588	0. 18
USD	3, 320, 000	ACRISURE LLC 4. 2500% 15/02/29 144A	2, 985, 992	0. 18
USD	3, 050, 000	SS&C TECH INC 5.5000% 30/09/27 144A	2, 976, 534	0. 18
USD	3, 275, 000	CHENIERE ENERGYP 4. 0000% 01/03/31	2, 973, 613	0. 18
USD	3, 200, 000	PRIMO WATER H 4. 3750% 30/04/29 144A	2, 945, 593	0. 18
USD	2, 850, 000	ONEMAIN FINANCE 7. 8750% 15/03/30	2, 938, 661	0. 18
USD	2, 975, 000	L BRANDS INC 5. 2500% 01/02/28	2, 911, 052	0. 17
USD	2, 875, 000	HARVEST MIDST 7.5000% 01/09/28 144A	2, 906, 539	0. 17
USD	2, 925, 000	LSF9 ATL/VIC 7.7500% 15/02/26 144A	2, 899, 902	0.17
USD	2, 875, 000	EMRLD BOR / E 6.6250% 15/12/30 144A	2, 897, 408	0. 17
USD	2, 875, 000	L BRANDS 6.75% 01/07/36	2, 896, 295	0. 17
USD	2, 950, 000	ENLINK MIDSTREAM PRT 4.85% 15/07/26	2, 891, 192	0. 17
USD	3, 400, 000	CSC HOLDINGS 6.5000% 01/02/29 144A	2, 888, 062	0. 17
USD	2,700,000	NCR ATLEOS LL 9.5000% 01/04/29 144A	2, 882, 604	0. 17
USD	2, 850, 000	GENESIS ENERGY 8.0000% 15/01/27	2, 876, 368	0. 17
USD	2, 950, 000	HILCORP ENERG 6.0000% 01/02/31 144A	2, 865, 305	0. 17
USD	3, 225, 000	SBA COMMUNICATI 3. 1250% 01/02/29 WI	2, 864, 069	0.17
USD	2,625,000	HILCORP ENERG 8.3750% 01/11/33 144A	2, 839, 042	0.17
USD	2, 950, 000	FERRELLGAS LP 5.8750% 01/04/29 144A	2, 822, 113	0.17
USD	2, 750, 000	CAESARS ENT 7.0000% 15/02/30 144A	2, 820, 304	0.17
USD	2, 800, 000	GENESIS ENERGY 7.7500% 01/02/28	2, 807, 140	0. 17
USD	2, 875, 000	YUM! BRANDS INC 5.3750% 01/04/32	2, 784, 107	0. 17
USD	2, 775, 000	ASCENT RESOUR 7.0000% 01/11/26 144A	2, 781, 235	0. 17
USD	2, 700, 000	HUB INTL LTD 7. 2500% 15/06/30 144A	2, 773, 737	0. 17
USD	3, 025, 000	BOYD GAMING C 4. 7500% 15/06/31 144A	2, 773, 668	0.17
USD	3, 100, 000	HILTON DOMEST 4. 0000% 01/05/31 144A	2, 772, 306	0. 17
USD	3, 200, 000	NRG ENERGY IN 3. 8750% 15/02/32 144A	2, 740, 003	0.17
USD	2, 950, 000			0. 16
		NCR VOYIX COR 5. 1250% 15/04/29 144A CCO HOLDINGS 4. 7500% 01/03/30 144A	2, 736, 954	0. 16 0. 16
USD	3, 175, 000		2, 735, 921	
USD	2, 700, 000	BEAZER HOMES USA 7. 2500% 15/10/29	2, 734, 717	0. 16
USD	2, 675, 000	UKG INC 6.8750% 01/02/31 144A	2, 723, 873	0. 16
USD	2, 700, 000	ALBERTSONS CO 6. 5000% 15/02/28 144A	2, 723, 687	0. 16
USD	2, 925, 000	EQM MIDSTREAM 4.7500% 15/01/31 144A	2, 716, 824	0. 16

USD 2,750,000 VISTRA OPERAT 5,6250% 15/02/27 144A 2,708,151 0.16 USD 2,750,000 REFEREN CORF 5,7300% 01/02/28 W1 2,691,929 0.16 USD 2,550,000 HOSPITALITY PROF 1,600%,01/02/29 2,692,5862 0.16 USD 2,550,000 ROCKIES EXPRE 4,5500% 15/07/29 144A 2,656,352 0.16 USD 2,250,000 SIRIUS XR RAD 4,0000% 15/07/29 144A 2,668,192 0.16 USD 2,250,000 SIRIUS XR RAD 4,0000% 15/07/29 144A 2,668,72 0.16 USD 2,255,000 SIRIUS XR RAD 4,0000% 15/07/29 144A 2,668,77 0.16 USD 2,255,000 MERPHY OIL CORF 5,5750% 01/12/27 USD 2,750,000 MERPHY OIL CORF 5,5750% 01/12/27 USD 2,255,000 MERPHY OIL CORF 5,1550% 01/12/27	通貨	数量/額面(1)	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD 2,750,000 CRIFFON CORP 5,7500% 01/03/28 WI 2,691,929 0.16 USD 3,275,000 HOSTIALITY PROP 4,5500% 01/01/29 144A 2,656,566 0.16 USD 2,950,000 ROWS CORP 3,8750% 15/06/29 144A 2,656,552 0.18 USD 2,900,000 SYNAPICS INC. 40,000% 15/07/29 144A 2,656,552 0.18 USD 2,900,000 SYNAPICS INC. 40,000% 15/07/29 144A 2,656,552 0.16 USD 2,265,000 SYNAPICS INC. 40,000% 15/07/29 144A 2,656,522 0.16 USD 2,650,000 ROWS CORP 5,8750% 01/07/29 144A 2,656,727 0.16 USD 2,655,000 ROWS CORP 5,8750% 01/07/29 144A 2,664,722 0.16 USD 2,655,000 RANCE RESOURCES S. 5,500% 15/07/29 144A 2,500,727 883 0.15 USD 2,655,000 RANCE RESOURCES S. 5,500% 15/07/29 144A 2,500,727 883 0.15 USD 2,655,000 ROWS CORP 5,8750% 01/04/28 144A 2,500,127 0.15 USD 2,615,000 EVERI HOLDING 5,000% 10/04/28 144A 2,500,127 0.15 USD 2,775,000 HILTON GRAND 5,000% 10/07/29 144A 2,501,427 0.15 USD 2,775,000 HILTON GRAND 5,000% 10/07/29 144A 2,501,427 0.15 USD 2,785,000 ANYWIRER EUC 7,000% 01/07/29 144A 2,501,427 0.15 USD 2,785,000 ANYWIRER EUC 7,000% 15/07/29 144A 2,501,427 0.15 USD 2,755,000 HILTON GRAND 5,000% 10/07/29 144A 2,501,400 0.15 USD 2,755,000 HILTON GRAND 5,000% 10/07/29 144A 2,501,400 0.15 USD 2,755,000 HILTON GRAND 5,000% 10/07/29 144A 2,501,600 0.15 USD 2,755,000 HILTON GRAND 5,000% 10/07/29 144A 2,501,600 0.15 USD 2,655,000 ANYWIRER EUC 7,000% 15/07/29 144A 2,501,600 0.15 USD 2,655,000 MOSS CREER T,5000% 15/07/29 144A 2,501,600 0.15 USD 2,655,000 KNETK HILDIN 5,8750% 15/07/29 144A 2,474,410 0.15 USD 2,650,000 KNETK HILDIN 5,8750% 15/07/29 144A 2,474,410 0.15 USD 2,650,000 KNETK HILDIN 5,8750% 15/07/29 144A 2,474,410 0.15 USD 2,650,000 KNETK HILDIN 5,8750% 15/07/29 144A 2,474,410 0.15 USD 2,650,000 KNETK HILDIN 5,8750% 15/07/29 144A 2,474,410 0.15 USD 2,650,000 KNETK HILDIN 5,8750% 15/07/29 144A 2,474,4910 0.15 USD 2,650,000 KNETK HILDIN 5,8750% 15/07/29 144A 2,474,4910 0.15 USD 2,650,000 KNETK HILDIN 5,8750% 15/07/29 144A 2,474,4910 0.15 USD 2,650,000 KNETK HILDIN 5,8750% 15/07/29 144A 2,474,4910 0.15 USD 2,650,000 KNETK HILDIN 5,8750% 15/07/29 144A 2,474,4910	TIGD	2 750 000	VISTRA OPERAT 5 69509/ 15/09/97 1444	2 702 151	0.16
USD 3, 275, 900 HOSPITALITY PROP 4, 9509% 61/10/29 2, 682, 666 0, 16 USD 2, 950, 900 NEWS CORP 3, 87509 15/06/29 144A 2, 675, 2442 0, 16 USD 2, 850, 900 SIRUS MR AD 4, 9009% 15/07/29 144A 2, 665, 522 0, 16 USD 2, 950, 900 SIRUS MR AD 4, 9009% 15/07/29 144A 2, 666, 522 0, 16 USD 2, 925, 900 SIRUS MR AD 4, 9009% 15/07/29 144A 2, 666, 522 0, 16 USD 2, 925, 900 SIRUS MR AD 4, 9009% 15/06/29 144A 2, 646, 8192 0, 16 USD 2, 925, 900 MRPHY OIL CORP 5, 87509% 01/10/1297 2, 644, 722 0, 16 USD 2, 500, 900 RANGE RESOURCES 8, 25099% 15/01/297 144A 2, 597, 883 0, 15 USD 2, 600, 900 ARCHROCK LP/F 6, 25099% 15/01/29 144A 2, 597, 883 0, 15 USD 2, 700, 900 NENSTAR ESCRO 5, 62509% 15/01/29 144A 2, 597, 883 0, 15 USD 2, 700, 900 VERH HOLDING 5, 6000% 15/07/27 144A 2, 591, 427 0, 15 USD 2, 775, 900 HILTON GRAND 5, 9009% 01/06/29 144A 2, 587, 7578 0, 15 USD 2, 775, 900 SOLTHWESTERK ENG 4, 7500% 01/07/24 144A 2, 581, 888 0, 15 USD 2, 775, 900 SOLTHWESTERK ENG 4, 7500% 01/07/24 144A 2, 581, 888 0, 15 USD 2, 655, 900 AVIS BIDGET C 5, 7500% 15/07/27 144A 2, 581, 888 0, 15 USD 2, 675, 900 BERK GLOBAL 5, 6209% 15/07/27 144A 2, 581, 888 0, 15 USD 2, 675, 900 ENG CORP GLOBAL 5, 6209% 15/07/27 144A 2, 581, 888 0, 15 USD 2, 675, 900 ENG GLOBAL 5, 6209% 15/07/27 144A 2, 581, 848 0, 15 USD 2, 675, 900 ENG GLOBAL 5, 6209% 15/07/27 144A 2, 581, 848 0, 15 USD 2, 675, 900 ENG GLOBAL 5, 6209% 15/07/27 144A 2, 581, 849 0, 15 USD 2, 505, 900 ENG GLOBAL 5, 6209% 15/07/27 144A 2, 581, 849 0, 15 USD 2, 505, 900 ALJED UNIVER 6, 62509% 15/07/27 144A 2, 581, 849 0, 15 USD 2, 505, 900 MSC CREER ET 7, 5000% 15/07/26 144A 2, 494, 90, 67 0, 15 USD 2, 457, 900 MSC CREER ET 7, 5000% 15/07/26 144A 2, 494, 90, 67 0, 15 USD 2, 457, 900 MSC CREER ET 7, 5000% 15/07/29 144A 2, 474, 232 0, 15 USD 2, 457, 900 MSC CREER ET 7, 5000% 15/07/29 144A 2, 474, 232 0, 15 USD 2, 457, 900 MSC CREER ET 7, 5000% 15/07/29 144A 2, 474, 232 0, 15 USD 2, 457, 900 MSC CREER ET 7, 5000% 15/07/29 144A 2, 474, 232 0, 15 USD 2, 457, 900 MSC CREER ET 7, 5000% 15/07/29 144A 2, 474, 232 0, 15 US					
USD 2, 925, 000 NEWS CORP 3, 8750% 15/05/29 144A 2, 666, 552 0, 16 USD 2, 900, 000 ROCKIES EXPRE 4, 9500% 15/07/29 144A 2, 666, 552 0, 16 USD 2, 900, 000 SYNAPTICS INC 4, 0000% 15/07/29 144A 2, 666, 552 0, 16 USD 2, 905, 000 SYNAPTICS INC 4, 0000% 15/07/29 144A 2, 626, 527 0, 16 USD 2, 850, 000 SYNAPTICS INC 4, 0000% 15/04/30 144A 2, 626, 527 0, 16 USD 2, 850, 000 RANGE REPORT 16/10/10/10/10/10/10/10/10/10/10/10/10/10/					
USD 2,850,000 ROCKIES EXPRE 4,9500% 15/07/29 144A 2,656,352 0,16 USD 2,905,000 SIRIUS XM RAD 4,000% 15/07/29 144A 2,648,192 0,16 USD 2,855,000 POST HOLDINGS 4,6250% 15/07/20 144A 2,666,637 0,16 USD 2,505,000 RARGE RESOURES 6,6250% 15/07/20 144A 2,666,637 0,16 USD 2,505,000 RARGE RESOURES 8,5500% 15/07/27 144A 2,616,037 0,16 USD 2,500,000 RARGE RESOURES 8,5500% 15/07/27 144A 2,501,000 RARGE RESOURES 8,5500% 15/07/27 144A 2,501,000 RARGE RESOURES 8,5500% 15/07/27 144A 2,501,407 0,15 USD 2,610,000 RARGE RESOURES 8,5500% 15/07/27 144A 2,501,407 0,15 USD 2,775,000 SOLTHWESTERS RESOURES 8,5500% 15/07/27 144A 2,501,407 0,15 USD 2,775,000 SOLTHWESTERS RESOURES 8,5500% 15/07/27 144A 2,501,407 0,15 USD 2,775,000 SOLTHWESTERS RES. 4,500% 0,106/29 144A 2,501,407 0,15 USD 2,750,000 ANWHERE RE/C 7,0000% 15/07/27 144A 2,501,407 0,15 USD 2,858,000 ANWHERE RE/C 7,0000% 15/07/27 144A 2,501,407 0,15 USD 2,650,000 AVE BUDGET C 5,7500% 15/07/27 144A 2,501,407 0,15 USD 2,550,000 AVE BUDGET C 5,7500% 15/07/27 144A 2,501,408 0,15 USD 2,550,000 AVE BUDGET C 5,7500% 15/07/27 144A 2,501,408 0,15 USD 2,505,000 AULIED UNIVER 6,6250% 15/07/27 144A 2,501,508 0,15 USD 2,505,000 AULIED UNIVER 6,6250% 15/07/27 144A 2,501,508 0,15 USD 2,505,000 AULIED UNIVER 6,6250% 15/07/27 144A 2,501,508 0,15 USD 2,505,000 AULIED UNIVER 6,6250% 15/07/27 144A 2,501,508 0,15 USD 2,505,000 OOD REST CHELLER F,5000 15/07/27 144A 2,501,500 0,15 USD 2,505,000 OOD REST CHELLER F,5000 15/07/28 144A 2,409,627 0,15 USD 2,505,000 OOD REST CHELLER F,5000 15/07/29 144A 2,409,627 0,15 USD 2,505,000 OOD REST CHELLER F,5000 15/07/29 144A 2,409,627 0,15 USD 2,505,000 OOD REST CHELLER F,5000 15/07/29 144A 2,409,607 0,15 USD 2,505,000 OOD REST CHELLER F,5000 15/07/29 144A 2,409,607 0,15 USD 2,505,000 OOD REST CHELLER F,5000 15/07/29 144A 2,409,607 0,15 USD 2,505,000 OOD REST CHELLER F,5000 15/07/29 144A 2,409,607 0,15 USD 2,505,000 OOD REST CHELLER F,5000 15/07/29 144A 2,409,607 0,15 USD 2,505,000 OOD REST CHELLER F,5000 15/07/29 144A 2,409,607 0,15 USD 2,500,000 OOD REST CHELLER					
USD 2, 900, 000 SIRIUS XM RAD 4, 0000% 15/07/28 144A 2, 645, 527 0, 16 USD 2, 850, 000 SYNAPTICS INC 4, 0000% 15/06/29 144A 2, 625, 527 0, 16 USD 2, 850, 000 POST HOLDINGS 4, 6250% 15/04/30 144A 2, 616, 087 0, 16 USD 2, 500, 000 RANGE RESOURCES 8, 2500% 15/04/30 144A 2, 504, 722 0, 16 USD 2, 500, 000 RANGE RESOURCES 8, 2500% 15/01/29 WI 2, 597, 883 0, 15 USD 2, 700, 000 RANGE RESOURCES 8, 2500% 15/01/29 WI 2, 597, 883 0, 15 USD 2, 700, 000 RESTAR ESCRO 5, 6250% 15/07/27 144A 2, 592, 215 0, 15 USD 2, 700, 000 RESTAR ESCRO 5, 6250% 15/07/27 144A 2, 591, 427 0, 15 USD 2, 700, 000 RESTAR ESCRO 5, 6250% 15/07/27 144A 2, 591, 427 0, 15 USD 2, 715, 000 SIR HOLDING 5, 6000% 15/07/27 144A 2, 591, 427 0, 15 USD 2, 775, 000 SOUTHWESTERN EN 4, 7500% 01/02/32 2, 249, 715 0, 15 USD 2, 775, 000 SOUTHWESTERN EN 4, 7500% 01/02/32 2, 249, 715 0, 15 USD 2, 625, 000 BYNAMERR REJC 7, 0000% 15/04/30 144A 2, 593, 788 0, 15 USD 2, 625, 000 BYNAMERR REJC 7, 0000% 15/04/30 144A 2, 594, 605 0, 15 USD 2, 675, 000 BYNAMERR REJC 7, 0000% 15/07/27 144A 2, 593, 388 0, 15 USD 2, 675, 000 BYNAMERR REJC 7, 6250% 15/07/27 144A 2, 594, 594, 594, 594, 594, 594, 594, 594					
USD 2,955,000 SYNAPTICS INC 4,0000% 15/06/29 144A 2,616,087 0.16 USD 2,650,000 PARCH HOLDINGS 4,6250% 15/04/30 144A 2,616,087 0.16 USD 2,605,000 RANGE RESOURCES 8,2500% 15/04/27 2,604,722 0.16 USD 2,605,000 RANGE RESOURCES 8,2500% 15/04/27 144A 2,592,883 0.15 USD 2,605,000 NEXTRA ESCOR 6,820% 15/04/28 144A 2,592,417 0.15 USD 2,615,000 EVERI HOLDING 5,0000% 15/07/29 144A 2,591,427 0.15 USD 2,615,000 EVERI HOLDING 5,0000% 15/07/29 144A 2,591,427 0.15 USD 2,775,000 HILTON GRAND 5,0000% 15/07/29 144A 2,591,427 0.15 USD 2,775,000 HILTON GRAND 5,0000% 15/07/29 144A 2,591,427 0.15 USD 2,775,000 HILTON GRAND 5,0000% 15/07/29 144A 2,591,427 0.15 USD 2,775,000 HILTON GRAND 5,0000% 15/07/29 144A 2,591,818 88 0.15 USD 2,805,000 ANWHERE RE/C 7,0000% 15/07/29 144A 2,591,605 0.15 USD 2,805,000 ANWHERE RE/C 7,0000% 15/07/27 144A 2,590,605 0.15 USD 2,605,000 REVER BUDGET 6,7500% 15/07/27 144A 2,590,508 0.15 USD 2,605,000 NEWS CORP 5,1250% 15/07/26 144A 2,99,607 0.15 USD 2,475,000 NEWS CORP 5,1250% 15/07/26 144A 2,99,607 0.15 USD 2,475,000 MOSS CREEK RE 7,5000% 15/07/26 144A 2,99,607 0.15 USD 2,475,000 MOSS CREEK RE 7,5000% 15/07/26 144A 2,474,910 0.15 USD 2,475,000 MOSS CREEK RE 7,5000% 15/07/26 144A 2,474,910 0.15 USD 2,475,000 MOSS CREEK RE 7,5000% 15/07/26 144A 2,474,910 0.15 USD 2,505,000 MOSS CREEK RE 7,5000% 15/07/26 144A 2,474,910 0.15 USD 2,505,000 MOSS CREEK RE 7,5000% 15/07/32 144A 2,474,910 0.15 USD 2,505,000 MOSS CREEK RE 7,5000% 15/07/32 144A 2,474,910 0.15 USD 2,505,000 MOSS CREEK RE 7,5000% 15/07/32 144A 2,474,910 0.15 USD 2,505,000 MOSS CREEK RE 7,5000% 15/07/32 144A 2,474,910 0.15 USD 2,505,000 MOSS CREEK RE 7,5000% 15/07/29 144A 2,474,910 0.15 USD 2,505,000 MOS					
USD 2,850,000 POST HOLDINGS 4,6250% 15/04/30 144A 2,616,087 0,16 USD 2,500,000 RANGE RESOURCES 8,2500% 15/01/29 WI 2,597,883 0,15 USD 2,500,000 RANGE RESOURCES 8,2500% 15/01/29 WI 2,597,883 0,15 USD 2,605,000 ARCHROCK LPT 6,2500% 10/04/28 144A 2,592,215 0,15 USD 2,700,000 NEXSTAR ESCRO 5,6250% 15/07/27 144A 2,591,427 0,15 USD 2,715,000 FURTH HOLDING 5,0000% 15/07/27 144A 2,591,427 0,15 USD 2,715,000 FURTH HOLDING 5,0000% 15/07/27 144A 2,581,588 0,15 USD 2,715,000 SUTHWESTERN ENR 4,7500% 01/06/29 144A 2,581,588 0,15 USD 2,750,000 SUTHWESTERN ENR 4,7500% 01/06/29 144A 2,581,888 0,15 USD 2,650,000 POST 10/07/20 144A 2,581,785 0,15 USD 2,650,000 POST 10/07/20 144A 2,582,785 0,15 USD 2,550,000 POST 10/07/20 144A 2,582,785 0,15 USD 2,550,000 POST 10/07/20 144A 2,582,785 0,15 USD 2,505,000 POST 10/07/20 144A 2,599,687 0,15 USD 2,505,000 POST 10/07/20 144A 2,599,687 0,15 USD 2,550,000 END 10/07/20 144A 2,996,687 0,15 USD 2,555,000 KINETIK HILDIN 5,8750% 15/07/31 2,483,647 0,15 USD 2,555,000 KINETIK HILDIN 5,8750% 15/07/31 2,483,647 0,15 USD 2,555,000 KINETIK HILDIN 5,8750% 15/07/31 44A 2,474,323 0,15 USD 2,575,000 CCC HIGG ILC/CAP 5,1259,01/05/27 144 2,451,920 0,15 USD 2,575,000 END MOUNTAIN 8,2500% 15/07/30 144A 2,452,339 0,15 USD 2,575,000 END MOUNTAIN 8,2500% 15/07/30 144A 2,452,399 0,15 USD 2,575,000 END MOUNTAIN 8,2500% 15/07/30 144A 2,452,590 0,15 USD 2,575,000 END MOUNTAIN 8,2500% 15/07/30 144A 2,452,590 0,15 USD 2,575,000 END MOUNTAIN 8,2500% 15/07/30 144A 2,452,590 0,15 USD 2,575,000 END MOUNTAIN 8,2500% 15/07/30 144A 2,452,590 0,15 USD 2,575,000 END MOUNTAIN 8,2500% 15/07/30 144A 2,452,590 0,15 USD 2,575,000 END MOUNTAIN 8,2500% 15/07/30 144A 2,462,949 0,14 USD 2,555,000 END MOUNTAIN 8,2500% 15/07/30 144A 2,462,949 0,14 USD 2,555,000 END MOUNTAIN 8,2500% 15/07/30 144A 2,462,949 0,14 USD 2,555,000 END MOUNTAIN 8,5000% 15/					
USD 2, 562,0000 RANGE RESOURCES 8, 2500% 1, 172/27 2, 604, 722 0, 16 USD 2, 605,0000 RANGE RESOURCES 8, 2500% 1, 15/01/29 WI 2, 557, 883 0, 15 USD 2, 605,0000 RANGE RESOURCES 8, 2500% 1, 15/01/29 WI 2, 557, 883 0, 15 USD 2, 615,0000 EVERL HOLDING 5, 0600% 1, 16/01/29 144A 2, 592, 215 0, 15 USD 2, 615,0000 EVERL HOLDING 5, 0600% 1, 16/01/29 144A 2, 581, 588 0, 15 USD 2, 775,0000 HLTON GRAND 5, 06000% 1, 16/01/29 144A 2, 581, 588 0, 15 USD 2, 775,0000 SOUTHWESTERN ENE 4, 75600% 0, 10/02/32 2, 549, 715 0, 15 USD 2, 858,0000 ANYHERE REVE 7, 75600% 0, 10/02/32 2, 549, 715 0, 15 USD 2, 625,0000 ANYB BUDGET C 5, 75600% 15/07/27 144A 2, 2581, 888 0, 15 USD 2, 565,0000 RERRY GLOBAL 5, 6250% 15/07/27 144A 2, 2581, 848 0, 15 USD 2, 565,0000 RERRY GLOBAL 5, 6250% 15/07/27 144A 2, 2581, 848 0, 15 USD 2, 565,0000 RERRY GLOBAL 5, 6250% 15/07/27 144A 2, 2581, 848 0, 15 USD 2, 565,0000 RERRY GLOBAL 5, 6250% 15/07/27 144A 2, 250, 828 0, 15 USD 2, 565,0000 RERRY GLOBAL 5, 6250% 15/07/27 144A 2, 250, 828 0, 15 USD 2, 565,0000 RERRY GLOBAL 5, 6250% 15/07/21 144A 2, 250, 828 0, 15 USD 2, 2655,0000 KNEWED RE 5, 5500% 15/07/21 144A 2, 250, 828 0, 15 USD 2, 275,000 GOODYEAR TIRE 5, 5500% 15/07/31 144A 2, 474, 910 0, 15 USD 2, 2650,000 RERRY GLOBAL 5, 8750% 15/07/32 144A 2, 474, 910 0, 15 USD 2, 2650,000 RERRY GLOBAL 5, 8750% 15/07/32 144A 2, 474, 930 0, 15 USD 2, 2600,000 RERRY GLOBAL 144A 2, 474, 930 0, 15 USD 2, 2600,000 RERRY SANGER SA					
USD 2, 500, 000 RANGE RESOURCES 8, 2500% 15/01/29 WI 2, 557, 883 0, 15 USD 2, 265, 000 ARCHROCK LPF 6, 2500% 01/04/28 1444 2, 551, 427 0, 15 USD 2, 700, 000 NEXSTAR ESCRO 5, 6250% 15/07/27 1444 2, 551, 427 0, 15 USD 2, 775, 000 SUUTHWESTERN 5, 0000% 16/07/29 1444 2, 551, 888 0, 15 USD 2, 775, 000 SUUTHWESTERN ENE 4, 7500% 01/02/32 2, 549, 715 0, 15 USD 2, 858, 000 ANYWHERE RE/C 7, 0000% 10/02/32 2, 549, 715 0, 15 USD 2, 858, 000 ANYWHERE RE/C 7, 0000% 15/04/30 1444 2, 540, 665 0, 15 USD 2, 850, 000 ANYWHERE RE/C 7, 0000% 15/04/30 1444 2, 540, 665 0, 15 USD 2, 550, 000 ANYWHERE RE/C 7, 0000% 15/04/30 1444 2, 540, 665 0, 15 USD 2, 550, 000 ANYWHERE RE/C 7, 57500% 15/04/30 1444 2, 541, 256 0, 15 USD 2, 550, 000 ALLIED UNIVER 6, 6250% 15/07/27 1444 2, 521, 256 0, 15 USD 2, 550, 000 ALLIED UNIVER 6, 6250% 15/07/27 1444 2, 251, 266 0, 15 USD 2, 255, 000 GOOVPEAR TIRE 5, 2500% 15/07/31 144, 34, 34, 34, 34, 34, 34, 34, 34, 34,					
USD 2, 625,000 ARCHROCK LP/F 6, 2509% of 1/04/28 144A 2, 592, 215 0, 15 USD 2, 700,000 NEXTAR ESCRO 5, 6250% 15/07/27 144A 2, 587, 578 0, 15 USD 2, 615,000 EVERI HOLDING 5, 0000% 16/07/29 144A 2, 587, 578 0, 15 USD 2, 775,000 HILTON GRAND 5, 0000% 01/06/29 144A 2, 587, 578 0, 15 USD 2, 775,000 SOUTHWESTERN ENE 4, 7500% 01/02/32 2, 549, 715 0, 15 USD 2, 858,000 AVIS BUDGET C 5, 7500% 15/07/32 144A 2, 587, 748 0, 15 USD 2, 625,000 BERRY GLOBAL 6, 6250% 15/07/27 144A 2, 538, 748 0, 15 USD 2, 650,000 BERRY GLOBAL 6, 6250% 15/07/27 144A 2, 538, 748 0, 15 USD 2, 675,000 FROM 10 NEWS CORP 5, 1250% 15/02/32 144A 2, 509, 598 0, 15 USD 2, 675,000 GOODYEAR TIRE 5, 2500% 15/02/31 44A 2, 509, 598 0, 15 USD 2, 755,000 GOODYEAR TIRE 5, 2500% 15/07/26 144A 2, 499, 627 0, 15 USD 2, 755,000 GOODYEAR TIRE 5, 2500% 15/07/31 2, 483, 647 0, 15 USD 2, 255,000 KINETIK HLDIN 5, 87509% 15/07/31 44A 2, 474, 910 0, 15 USD 2, 555,000 KINETIK HLDIN 5, 87509% 15/07/32 144A 2, 474, 910 0, 15 USD 2, 575,000 CCO HDG LLC/CAP 5, 123% 01/05/27 144 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 575,000 CCO HDG LLC/CAP 5, 123% 01/05/27 144 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 575,000 CCO HDG LLC/CAP 5, 125% 01/05/27 144 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 575,000 CCO HDG LLC/CAP 5, 125% 01/05/27 144 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 575,000 CCO HDG LLC/CAP 5, 125% 01/05/27 144 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 575,000 CCO HDG LLC/CAP 5, 125% 01/05/27 144 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 575,000 CCO HDG LLC/CAP 5, 125% 01/05/27 144 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 575,000 CCO HDG LLC/CAP 5, 125% 01/05/27 144 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 575,000 CCO HDG LLC/CAP 5, 125% 01/05/27 144 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 575,000 FROM MAINTAIN 5, 2500% 15/07/39 144A 2, 452, 459, 450 0, 14 USD 2, 575,000 FROM MAINTAIN 5, 2500% 15/07/39 144A 2, 452, 452, 450, 657 0, 15 USD 2, 575,000 FROM MAINTAIN 5, 2500% 15/07/39 144A 2, 452, 452, 450, 667 0, 15 USD 2, 575,000 FROM MAINTAIN 5, 2500% 15/07/29 144A 2, 452, 459, 460 0, 14 USD 2, 250,000 FROM MAINTAIN 7, 0000% 15/07/29 144A 2, 422, 452, 450 0, 14 USD 2, 250,000 FROM MAINTAIN 7, 0000% 15/07/29 144A 2, 2					
USD 2, 700, 000 NEXTAR ESCRO 5, 6250% 15/07/27 1444A 2, 591, 427 0, 15 USD 2, 615, 000 EVERI HOLDING 5, 0000% 61/07/29 144A 2, 581, 888 0, 15 USD 2, 775, 000 SUUTHWESTERN ENE 4, 7500% 01/02/32 2, 549, 715 0, 15 USD 2, 775, 000 SUUTHWESTERN ENE 4, 7500% 01/02/32 2, 549, 715 0, 15 USD 2, 858, 000 ANYWHERE RE/C 7, 0000% 15/04/30 144A 2, 581, 888 0, 15 USD 2, 858, 000 ANYWHERE RE/C 7, 0000% 15/04/30 144A 2, 581, 866 0, 15 USD 2, 550, 000 BERRY GLOBAL 5, 6250% 15/07/27 144A 2, 584, 696 0, 15 USD 2, 550, 000 BERRY GLOBAL 5, 6250% 15/07/27 144A 2, 521, 326 0, 15 USD 2, 550, 000 ALLIED UNIVER 6, 6250% 15/07/27 144A 2, 592, 958 0, 15 USD 2, 550, 000 ALLIED UNIVER 6, 6250% 15/07/26 144A 2, 499, 627 0, 15 USD 2, 750, 000 GODYPART TIRE 5, 2500% 15/07/31 1, 2, 483, 647 0, 15 USD 2, 475, 000 GODYPART TIRE 5, 2500% 15/07/31 1, 2, 483, 647 0, 15 USD 2, 2650, 000 MOSS CREEK RE 7, 5000% 15/01/26 144A 2, 474, 323 0, 15 USD 2, 550, 000 MOSS CREEK RE 7, 5000% 15/01/26 144A 2, 474, 323 0, 15 USD 2, 5000 GODYPART TIRE 5, 2500% 15/07/30 144A 2, 474, 323 0, 15 USD 2, 5000 GODYPART TIRE 5, 2500% 15/07/30 144A 2, 474, 323 0, 15 USD 2, 5000 GODYPART TIRE 5, 2500% 15/07/30 144A 2, 474, 323 0, 15 USD 2, 5000 GODYPART TIRE RE 5, 2500% 15/07/30 144A 2, 474, 323 0, 15 USD 2, 5000 GODYPART TIRE RE 5, 2500% 15/07/30 144A 2, 452, 570 0, 15 USD 2, 575, 000 GROW ADMINIAN 8, 5000% 15/07/30 144A 2, 452, 570 0, 15 USD 2, 575, 000 GROW ADMINIAN 8, 5000% 15/07/30 144A 2, 452, 570 0, 15 USD 2, 575, 000 GROW ADMINIAN 8, 5000% 15/07/30 144A 2, 452, 570 0, 15 USD 2, 550, 000 GROW ADMINIAN 8, 5000% 15/07/30 144A 2, 452, 570 0, 14 USD 2, 550, 000 GROW ADMINIAN 8, 5000% 15/07/39 144A 2, 452, 570 0, 14 USD 2, 550, 000 GROW ADMINIAN 8, 5000% 15/07/39 144A 2, 452, 570 0, 14 USD 2, 550, 000 GROW ADMINIAN 8, 5000% 15/07/39 144A 2, 452, 570 0, 14 USD 2, 550, 000 GROW ADMINIAN 8, 5000% 15/07/39 144A 2, 452, 570 0, 14 USD 2, 550, 000 GROW ADMINIAN 8, 5000% 15/07/39 144A 2, 452, 570 0, 14 USD 2, 250, 000 GROW ADMINIAN 8, 5000% 15/07/39 144A 2, 452, 570 0, 14 USD 2, 250					
USD 2, 615, 000 EVERI HOLDING 5, 0000% 15/07/29 144A 2, 587, 578 0, 15 USD 2, 775, 000 SOUTHWESTERN ENE 4, 7500% 01/02/32 2, 549, 715 0, 15 USD 2, 755, 000 SOUTHWESTERN ENE 4, 7500% 01/02/32 2, 549, 715 0, 15 USD 2, 685, 000 AVIS BUDGET C 5, 7500% 15/04/30 144A 2, 538, 748 0, 15 USD 2, 655, 000 BERRY GLOBAL 5, 6250% 15/07/27 144A 2, 538, 748 0, 15 USD 2, 655, 000 EBRRY GLOBAL 5, 6250% 15/07/27 144A 2, 538, 748 0, 15 USD 2, 675, 000 NEWS CORP 5, 1250% 15/07/27 144A 2, 509, 598 0, 15 USD 2, 675, 000 ALIED UNIVER 6, 6250% 15/07/26 144A 2, 649, 627 0, 15 USD 2, 725, 000 GOODYEAR TIRE 5, 2500% 15/07/31 2, 483, 647 0, 15 USD 2, 755, 000 KINETIR HIDIN 5, 8750% 15/07/32 144A 2, 474, 910 0, 15 USD 2, 525, 000 KINETIR HIDIN 5, 8750% 15/06/30 144A 2, 474, 323 0, 15 USD 2, 557, 000 CCO HIDIN 5, 8750% 15/06/30 144A 2, 474, 323 0, 15 USD 2, 575, 000 CCO HIDIN 5, 8750% 15/06/30 144A 2, 474, 920 0, 15 USD 2, 575, 000 CCO HIDIN 5, 8750% 15/07/32 144A 2, 459, 520 0, 15 USD 2, 575, 000 CCO HIDIN 5, 8750% 15/07/32 144A 2, 459, 520 0, 15 USD 2, 575, 000 CCO HIDIN 5, 8750% 15/07/30 144A 2, 459, 520 0, 15 USD 2, 575, 000 CCO HIDIN 18, 5000% 15/07/30 144A 2, 459, 520 0, 15 USD 2, 575, 000 CCO HIDIN 18, 5000% 15/07/30 144A 2, 459, 520 0, 15 USD 2, 575, 000 CCO HIDIN 18, 5000% 15/07/30 144A 2, 459, 520 0, 15 USD 2, 575, 000 CCO HIDIN 18, 5000% 15/07/30 144A 2, 459, 520 0, 15 USD 2, 555, 000 SOUTHWESTERN ENE 5, 3750% 15/03/30 2, 249, 419 0, 14 USD 2, 505, 000 CROWN AMERICAS L 5, 2500% 01/07/29 144A 2, 432, 570 0, 14 USD 2, 505, 000 FROWN MINIST S, 10000% 11/07/29 144A 2, 432, 570 0, 14 USD 2, 505, 000 FROWN MINIST S, 10000% 11/07/29 144A 2, 432, 570 0, 14 USD 2, 505, 000 FROWN MINIST S, 10000% 11/07/29 144A 2, 402, 929 0, 14 USD 2, 505, 000 FROWN MINIST S, 10000% 11/07/29 144A 2, 402, 929 0, 14 USD 2, 505, 000 FROWN MINIST S, 10000% 11/07/29 144A 2, 402, 929 0, 14 USD 2, 505, 000 FROWN MINIST S, 10000% 11/07/29 144A 2, 402, 929, 90 0, 14 USD 2, 405, 000 FROWN MINIST S, 100000% 11/07/29 144A 2, 405, 900 0, 14 USD 2, 405, 000 FROWN MINIST					
USD 2, 775, 000 HILTON GRAND 5, 0000% 01/06/29 144A 2, 581, 888 0, 15 USD 2, 775, 000 SOUTHWESTERN ENE A, 7500% 01/02/32 2, 549, 715 0, 15 USD 2, 858, 000 ANYWHERE RE/C T, 0000% 15/04/30 144A 2, 540, 605 0, 15 USD 2, 625, 000 BERRY GLOBAL 5, 6250% 15/07/27 144A 2, 521, 326 0, 15 USD 2, 550, 000 BERRY GLOBAL 5, 6250% 15/07/27 144A 2, 521, 326 0, 15 USD 2, 505, 000 ALLIED UNIVER 6, 6250% 15/07/27 144A 2, 521, 326 0, 15 USD 2, 505, 000 ALLIED UNIVER 6, 6250% 15/07/26 144A 2, 499, 627 0, 15 USD 2, 705, 000 GOODYEAR TIRE 5, 2500% 15/07/31 4, 44, 42, 479, 191 0, 15 USD 2, 475, 000 MOSS CREEK RE 7, 5000% 15/07/31 4, 44, 42, 474, 323 0, 15 USD 2, 475, 000 MOSS CREEK RE 7, 5000% 15/07/31 44A 2, 474, 323 0, 15 USD 2, 505, 000 KINETIR H.IDD N. 5, 8750% 15/06/30 144A 2, 474, 323 0, 15 USD 2, 500, 000 IRON MOUNTAIN 5, 6250% 15/07/32 144A 2, 452, 339 0, 15 USD 2, 5075, 000 CO HOS LIC/CAP 5, 125% 01/05/27 144 2, 452, 339 0, 15 USD 2, 457, 000 CHS/COMMUNITY 8, 0000% 15/03/26 144A 2, 452, 339 0, 15 USD 2, 457, 000 CHS/COMMUNITY 8, 0000% 15/03/36 144A 2, 450, 567 0, 15 USD 2, 575, 000 RON MOUNTAIN 5, 2500% 15/07/30 144A 2, 450, 567 0, 15 USD 2, 500, 000 CROWN AMERICAS 1, 5, 2500% 01/07/29 144A 2, 450, 567 0, 15 USD 2, 500, 000 CROWN AMERICAS 1, 5, 2500% 01/07/39 144A 2, 429, 570 0, 14 USD 2, 505, 000 SUITHWESTERN ENE 5, 3750% 15/03/30 2, 429, 419 0, 14 USD 2, 500, 000 CROWN AMERICAS 1, 5, 2500% 01/07/39 144A 2, 402, 990 0, 14 USD 2, 500, 000 CROWN AMERICAS 1, 5, 2500% 01/07/29 144A 2, 402, 990 0, 14 USD 2, 500, 000 CROWN AMERICAS 1, 5, 2500% 01/07/29 144A 2, 393, 991 0, 14 USD 2, 457, 000 CALPINE CORP 5, 1250% 15/06/28 144A 2, 393, 991 0, 14 USD 2, 457, 000 CALPINE CORP 5, 1250% 15/06/28 144A 2, 393, 991 0, 14 USD 2, 457, 000 CALPINE CORP 5, 1250% 15/06/29 144A 2, 393, 991 0, 14 USD 2, 250, 000 SIRUIS XM RAD 5, 5000% 15/07/29 144A 2, 393, 991 0, 14 USD 2, 250, 000 FRON MONTAIN 7, 0000% 15/09/29 144A 2, 393, 991 0, 14 USD 2, 250, 000 FRON MONTAIN 7, 0000% 15/09/29 144A 2, 393, 991 0, 14 USD 2, 250, 000 FRON MONTAIN 7, 0000% 15/09					
USD 2, 575, 000 SOUTHWESTERN ENE 4, 7500% 10/02/32 2, 549, 715 0, 15 USD 2, 685, 000 AVIS BUDGET C 5, 7500% 15/04/30 144A 2, 538, 748 0, 15 USD 2, 655, 000 BERRY GLOBAL 5, 6250% 15/07/27 144A 2, 538, 748 0, 15 USD 2, 675, 000 NEWS CORP 5, 1250% 15/07/27 144A 2, 509, 598 0, 15 USD 2, 675, 000 NEWS CORP 5, 1250% 15/07/27 144A 2, 509, 598 0, 15 USD 2, 675, 000 ALIED UNIVER 6, 6250% 15/07/26 144A 2, 949, 627 0, 15 USD 2, 725, 000 GOODYLAR TIRE 5, 2500% 15/07/31 2, 483, 647 0, 15 USD 2, 755, 000 KINETIK H.DIN 5, 8750% 15/07/32 144A 2, 474, 910 0, 15 USD 2, 525, 000 KINETIK H.DIN 5, 8750% 15/06/30 144A 2, 474, 910 0, 15 USD 2, 525, 000 KINETIK H.DIN 5, 8750% 15/06/30 144A 2, 474, 910 0, 15 USD 2, 507, 000 CCO HDG ILC/CAP 5, 125% 01/06/30 144A 2, 474, 923 0, 15 USD 2, 575, 000 CCO HDG ILC/CAP 5, 125% 01/06/37 144A 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 575, 000 CCO HDG ILC/CAP 5, 125% 01/06/37 144A 2, 450, 567 0, 15 USD 2, 575, 000 IRON MOINTAIN 5, 62500% 15/07/30 144A 2, 450, 567 0, 15 USD 2, 575, 000 SOUTHWESTERN ENE 5, 3750% 15/07/30 144A 2, 422, 429, 419 0, 14 USD 2, 505, 000 SOUTHWESTERN ENE 5, 3750% 15/08/30 2, 242, 419 0, 14 USD 2, 500, 000 CROWN AMERICAS 1, 5, 2500% 01/07/29 144A 2, 402, 990 0, 14 USD 2, 500, 000 CROWN AMERICAS 1, 5, 2500% 01/07/29 144A 2, 402, 990 0, 14 USD 2, 500, 000 HEALTHEQUITY 4, 5000% 01/10/29 144A 2, 402, 990 0, 14 USD 2, 500, 000 HEALTHEQUITY 4, 5000% 01/10/29 144A 2, 402, 990 0, 14 USD 2, 475, 000 HESS MIDSTERS 5, 1520% 15/02/29 144A 2, 299, 099 0, 14 USD 2, 475, 000 HESS MIDSTERS 5, 1520% 15/02/29 144A 2, 299, 099 0, 14 USD 2, 475, 000 HESS MIDSTERS 5, 1520% 15/02/29 144A 2, 299, 099 0, 14 USD 2, 475, 000 FRON MOINTAIN 7, 0000% 15/02/29 144A 2, 299, 1999 0, 14 USD 2, 450, 000 FRON MOINTAIN 7, 0000% 15/02/29 144A 2, 299, 1999 0, 14 USD 2, 450, 000 FRON MOINTAIN 7, 0000% 15/02/29 144A 2, 299, 1999 0, 14 USD 2, 450, 000 FRON MOINTAIN 7, 0000% 15/02/29 144A 2, 299, 1999 0, 14 USD 2, 450, 000 FRON MOINTAIN 7, 0000% 15/02/29 144A 2, 298, 153 0, 14 USD 2, 250, 000 ON FRON MOINTAIN 7, 0000% 15/02/29 144A	USD				
USD 2, 265, 000 ANY-WHERE RE/C T. 0000% 15/04/30 144A 2, 540, 605 0, 15 USD 2, 625, 000 AVIS BUDGET C 5, 7500% 15/07/27 144A 2, 538, 748 0, 15 USD 2, 675, 000 NEWS CORP 5, 1250% 15/07/27 144A 2, 509, 588 0, 15 USD 2, 675, 000 ALLIED UNIVER 6, 6250% 15/07/26 144A 2, 509, 588 0, 15 USD 2, 725, 000 GOOD TAR TIRE 5, 2500% 15/07/26 144A 2, 499, 627 0, 15 USD 2, 725, 000 GOOD TAR TIRE 5, 2500% 15/07/26 144A 2, 499, 627 0, 15 USD 2, 475, 000 MOSS CREEK RE 7, 5000% 15/07/26 144A 2, 474, 910 0, 15 USD 2, 525, 000 KINETIK H.DIN S, 8750% 15/06/30 144A 2, 474, 910 0, 15 USD 2, 560, 000 IRON MOUNTAIN 5, 6250% 15/07/32 144A 2, 474, 910 0, 15 USD 2, 560, 000 IRON MOUNTAIN 5, 6250% 15/07/32 144A 2, 452, 339 0, 15 USD 2, 575, 000 CCO HIGG LLC/CAP 5, 125% 01/05/27 144 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 575, 000 CHS/COMMUNITY 8, 0000% 15/03/26 144A 2, 452, 339 0, 15 USD 2, 575, 000 CHS/COMMUNITY 8, 0000% 15/03/36 144A 2, 450, 567 0, 15 USD 2, 575, 000 SOUTHWESTERN ENS 5, 3750% 15/03/30 2, 429, 419 0, 14 USD 2, 560, 000 SOUTHWESTERN ENS 5, 3750% 15/03/30 2, 429, 419 0, 14 USD 2, 560, 000 SURIUS XM RAD 5, 5000% 01/07/29 144A 2, 402, 292 0, 14 USD 2, 560, 000 SIRIUS XM RAD 5, 5000% 01/07/29 144A 2, 402, 292 0, 14 USD 2, 560, 000 HEALTHEQUITY 4, 5000% 01/07/29 144A 2, 402, 292 0, 14 USD 2, 475, 000 HEALTHEQUITY 4, 5000% 01/07/29 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 475, 000 HEALTHEQUITY 4, 5000% 01/07/29 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 475, 000 CALPINE CORP 5, 1250% 15/03/28 144A 2, 393, 991 0, 14 USD 2, 250, 000 FRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/03/29 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 250, 000 FRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/03/29 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 250, 000 FRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/03/29 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 250, 000 FRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/03/29 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 250, 000 FRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/03/29 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 250, 000 FRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/03/29 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 250, 000 FRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/03/29 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 250, 000 FRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/03/29 144A 2, 391, 199 0,	USD				0. 15
USD 2,560,000 AVIS BUDGET C 5,7500% 15/07/27 144A 2,538,748 0,15 USD 2,560,000 RERRY GLOBAL 5,6250% 15/07/27 144A 2,501,326 0,15 USD 2,675,000 NEWS CORP 5,1250% 15/07/28 144A 2,509,598 0,15 USD 2,505,000 ALIJED UNIVER 6,6250% 15/07/28 144A 2,509,598 0,15 USD 2,725,000 GODYPAR TIRE 5,2500% 15/07/28 144A 2,409,627 0,15 USD 2,725,000 GODYPAR TIRE 5,2500% 15/07/31 2,483,647 0,15 USD 2,475,000 MOSS CREEK R 7,5000% 15/07/26 144A 2,474,910 0,15 USD 2,525,000 KINETIK HLDIN 5,8750% 15/06/30 144A 2,474,323 0,15 USD 2,525,000 KINETIK HLDIN 5,8750% 15/06/30 144A 2,474,323 0,15 USD 2,575,000 CCO HDG LLC/CAP 5,125% 01/05/27 144 2,451,920 0,15 USD 2,575,000 CCO HDG LLC/CAP 5,125% 01/05/27 144 2,451,920 0,15 USD 2,575,000 URON MOUNTAIN 5,62500% 15/07/30 144A 2,452,570 0,14 USD 2,575,000 SOUTHWESTERN NEE 5,3750% 15/03/30 2,429,419 0,14 USD 2,550,000 SOUTHWESTERN NEE 5,3750% 15/03/30 2,429,419 0,14 USD 2,500,000 ROWN AMERICAS L 5,2500% 01/04/30 2,416,929 0,14 USD 2,500,000 HEALTHEQUITY 4,5000% 01/07/29 144A 2,402,990 0,14 USD 2,500,000 HEALTHEQUITY 4,5000% 01/07/29 144A 2,402,990 0,14 USD 2,260,000 HEALTHEQUITY 4,5000% 01/07/29 144A 2,402,222 0,14 USD 2,250,000 SRIUS XM RAD 5,5000% 15/06/27 144A 2,339,991 0,14 USD 2,250,000 FRON MOUNTAIN 5,7000% 01/07/29 144A 2,402,292 0,14 USD 2,250,000 FRON MOUNTAIN 5,7000% 01/07/29 144A 2,339,391 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRES ALISON 15/06/28 144A 2,339,391 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRE CORP 5,1250% 15/03/29 144A 2,339,391 0,14 USD 2,250,000 FRON MOUNTAIN 7,0000% 15/02/29 144A 2,339,374 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRE CORP 5,1250% 15/03/29 144A 2,339,374 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRE CORP 5,1250% 15/03/29 144A 2,339,374 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRE CORP 5,1250% 15/03/29 144A 2,339,374 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRE CORP 5,1250% 15/03/29 144A 2,339,374 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRE CORP 5,1250% 15/03/29 144A 2,339,374 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRE CORP 5,1250% 15/03/29 144A 2,338,377 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRE CORP 5,1250% 15/03/29 144A 2,338,377 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRE CORP 5,1250% 15/03/29 144A	USD	2, 775, 000		2, 549, 715	0. 15
USD 2,560,000 AVIS BUDGET C 5,7500% 15/07/27 144A 2,538,748 0,15 USD 2,560,000 RERRY GLOBAL 5,6250% 15/07/27 144A 2,501,326 0,15 USD 2,675,000 NEWS CORP 5,1250% 15/07/28 144A 2,509,598 0,15 USD 2,505,000 ALIJED UNIVER 6,6250% 15/07/28 144A 2,509,598 0,15 USD 2,725,000 GODYPAR TIRE 5,2500% 15/07/28 144A 2,409,627 0,15 USD 2,725,000 GODYPAR TIRE 5,2500% 15/07/31 2,483,647 0,15 USD 2,475,000 MOSS CREEK R 7,5000% 15/07/26 144A 2,474,910 0,15 USD 2,525,000 KINETIK HLDIN 5,8750% 15/06/30 144A 2,474,323 0,15 USD 2,525,000 KINETIK HLDIN 5,8750% 15/06/30 144A 2,474,323 0,15 USD 2,575,000 CCO HDG LLC/CAP 5,125% 01/05/27 144 2,451,920 0,15 USD 2,575,000 CCO HDG LLC/CAP 5,125% 01/05/27 144 2,451,920 0,15 USD 2,575,000 URON MOUNTAIN 5,62500% 15/07/30 144A 2,452,570 0,14 USD 2,575,000 SOUTHWESTERN NEE 5,3750% 15/03/30 2,429,419 0,14 USD 2,550,000 SOUTHWESTERN NEE 5,3750% 15/03/30 2,429,419 0,14 USD 2,500,000 ROWN AMERICAS L 5,2500% 01/04/30 2,416,929 0,14 USD 2,500,000 HEALTHEQUITY 4,5000% 01/07/29 144A 2,402,990 0,14 USD 2,500,000 HEALTHEQUITY 4,5000% 01/07/29 144A 2,402,990 0,14 USD 2,260,000 HEALTHEQUITY 4,5000% 01/07/29 144A 2,402,222 0,14 USD 2,250,000 SRIUS XM RAD 5,5000% 15/06/27 144A 2,339,991 0,14 USD 2,250,000 FRON MOUNTAIN 5,7000% 01/07/29 144A 2,402,292 0,14 USD 2,250,000 FRON MOUNTAIN 5,7000% 01/07/29 144A 2,339,391 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRES ALISON 15/06/28 144A 2,339,391 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRE CORP 5,1250% 15/03/29 144A 2,339,391 0,14 USD 2,250,000 FRON MOUNTAIN 7,0000% 15/02/29 144A 2,339,374 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRE CORP 5,1250% 15/03/29 144A 2,339,374 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRE CORP 5,1250% 15/03/29 144A 2,339,374 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRE CORP 5,1250% 15/03/29 144A 2,339,374 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRE CORP 5,1250% 15/03/29 144A 2,339,374 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRE CORP 5,1250% 15/03/29 144A 2,339,374 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRE CORP 5,1250% 15/03/29 144A 2,338,377 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRE CORP 5,1250% 15/03/29 144A 2,338,377 0,14 USD 2,250,000 FRON TIRE CORP 5,1250% 15/03/29 144A	USD	2, 858, 000	ANYWHERE RE/C 7.0000% 15/04/30 144A	2, 540, 605	0. 15
USD 2, 650, 000 BERRY GLOBAL 5, 6250% 15/07/27 144A 2, 501, 326 0, 15 USD 2, 675, 000 NEWS CORP 5, 1250% 15/07/26 144A 2, 509, 598 0, 15 USD 2, 2505, 000 ALLIED UNIVER 6, 6250% 15/07/26 144A 2, 499, 627 0, 15 USD 2, 275, 000 GODYBAR TIRE 5, 2500% 15/07/26 144A 2, 499, 627 0, 15 USD 2, 2475, 000 MOSS CREEK RE 7, 5000% 15/07/26 144A 2, 474, 910 0, 15 USD 2, 255, 000 KINETIK HLDIN 5, 8750% 15/06/30 144A 2, 474, 910 0, 15 USD 2, 260, 000 IRON MOUNTAIN 5, 6250% 15/07/32 144A 2, 472, 339 0, 15 USD 2, 5675, 000 CCO HIG LIC/CAP 5, 125% 01/05/27 144 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 575, 000 CCH HIG LIC/CAP 5, 125% 01/05/27 144 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 457, 000 CHS/COMMUNITY 8, 0000% 15/07/32 144A 2, 452, 339 0, 15 USD 2, 575, 000 CHS/COMMUNITY 8, 0000% 15/07/32 144A 2, 452, 570 0, 15 USD 2, 575, 000 CHS/COMMUNITY 8, 0000% 15/07/30 144A 2, 450, 567 0, 15 USD 2, 575, 000 SOUTHWESTERN ENE 5, 3750% 15/03/30 2, 429, 419 0, 14 USD 2, 525, 000 SRIUS XM RAD 5, 5000% 01/04/30 2, 416, 929 0, 14 USD 2, 500, 000 CROWN AMERICAS L 5, 2500% 01/04/30 2, 416, 929 0, 14 USD 2, 560, 000 HEALTHEQUITY 4, 5000% 01/07/29 144A 2, 402, 900 0, 14 USD 2, 575, 000 BRON MOUNTAIN 7, 5000% 01/07/29 144A 2, 402, 900 0, 14 USD 2, 560, 000 HEALTHEQUITY 4, 5000% 01/10/29 144A 2, 402, 900 0, 14 USD 2, 350, 000 RON MOUNTAIN 7, 0000% 15/06/29 144A 2, 393, 991 0, 14 USD 2, 475, 000 CALPINE CORF 5, 1250% 15/03/29 144A 2, 393, 391 0, 14 USD 2, 450, 000 FRONTIER CORF 5, 1250% 15/03/29 144A 2, 393, 374 0, 14 USD 2, 450, 000 FRONTIER COMF 8, 5750% 15/03/29 144A 2, 393, 374 0, 14 USD 2, 245, 000 FRONTIER COMF 8, 5750% 15/03/29 144A 2, 393, 374 0, 14 USD 2, 250, 000 SROVER COMF 15/09/29 144A 2, 393, 374 0, 14 USD 2, 260, 000 FRONTIER COMF 8, 5750% 15/03/29 144A 2, 362, 753 0, 14 USD 2, 250, 000 FRONTIER COMF 8, 5750% 15/03/29 144A 2, 362, 753 0, 14 USD 2, 250, 000 FRONTIER COMF 8, 5750% 15/03/29 144A 2, 362, 753 0, 14 USD 2, 250, 000 FRONTIER COMF 8, 5750% 15/03/29 144A 2, 362, 753 0, 14 USD 2, 250, 000 FRONTIER COMF 8, 5750% 15/03/29 144A 2, 362, 753 0, 14 USD 2, 250, 000	USD	2,625,000	AVIS BUDGET C 5.7500% 15/07/27 144A	2, 538, 748	0. 15
USD 2, 675, 000 NEWS CORP 5, 1250% 15/02/32 144A 2, 509, 598 0, 15 USD 2, 505, 000 ALLIED UNIVER, 6,6250% 15/07/31 2, 483, 647 0, 15 USD 2, 475, 000 GOODYEAR TIRE 5, 2500% 15/07/31 2, 483, 647 0, 15 USD 2, 475, 000 MOSS CREER RE 7, 5000% 15/07/31 2, 483, 647 0, 15 USD 2, 525, 000 KINETIK HLDIN 5, 8750% 15/06/30 144A 2, 474, 910 0, 15 USD 2, 600, 000 IRON MOUNTAN 5, 6250% 15/07/32 144A 2, 452, 339 0, 15 USD 2, 575, 000 CCO HDG LLC/CAP 5, 125% 01/05/27 144 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 575, 000 CCO HDG LLC/CAP 5, 125% 01/05/27 144 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 575, 000 CHS/COMMUNITY 8, 0000% 15/03/26 144A 2, 432, 570 0, 14 USD 2, 575, 000 RON MOUNTAN 5, 6250% 15/07/30 144A 2, 432, 570 0, 14 USD 2, 525, 000 SOUTHWESTERN ENE 5, 3750% 15/03/30 2, 429, 419 0, 14 USD 2, 500, 000 CROWN AMERICAS L. 5, 2500% 01/04/30 2, 416, 929 0, 14 USD 2, 525, 000 SIRIUS XM RAD 5, 5000% 01/07/29 144A 2, 402, 990 0, 14 USD 2, 525, 000 FIBALTHEQUITY 4, 50000% 01/07/29 144A 2, 402, 990 0, 14 USD 2, 525, 000 FIBALTHEQUITY 4, 5000% 01/07/29 144A 2, 402, 990 0, 14 USD 2, 475, 000 FIBALTHEQUITY 4, 5000% 15/07/29 144A 2, 402, 990 0, 14 USD 2, 350, 000 IRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/02/29 144A 2, 939, 991 0, 14 USD 2, 350, 000 IRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/02/29 144A 2, 393, 991 0, 14 USD 2, 475, 000 CALPINE COMP 5, 1250% 15/03/29 144A 2, 393, 991 0, 14 USD 2, 450, 000 FIBOLTE A, 12500 15/03/29 144A 2, 393, 991 0, 14 USD 2, 250, 000 SRA COMMUNICATIO 3, 8750% 15/03/29 144A 2, 389, 374 0, 14 USD 2, 250, 000 FRONTEC COMP 5, 12500% 15/03/29 144A 2, 371, 766 0, 14 USD 2, 245, 000 SPA COMMUNICATIO 3, 8750% 15/03/21 144A 2, 368, 307 0, 14 USD 2, 245, 000 SPA COMMUNICATIO 3, 8750% 15/02/27 2, 388, 307 0, 14 USD 2, 250, 000 SPA COMMUNICATIO 3, 8750% 15/07/21 144A 2, 369, 153 USD 2, 2450, 000 FRONTERPRIS 5, 25000% 15/07/28 144A 2, 369, 153 USD 2, 250, 000 FRONTERPRIS 5, 25000% 15/07/29 144A 2, 369, 153 USD 2, 250, 000 FRONTERPRIS 5, 25000% 15/07/29 144A 2, 369, 153 USD 2, 250, 000 FRONTERPRIS 5, 25000% 15/07/29 144A 2, 2, 369, 563 0, 14 USD 2, 250, 000 FRONTERPRIS 5, 2500	USD	2, 550, 000	BERRY GLOBAL 5,6250% 15/07/27 144A	2, 521, 326	0.15
USD 2, 2505,000 ALLIED UNIVER 6, 6250% 15/07/26 144A 2, 499, 627 0.15 USD 2, 725,000 GOODYEAR TIRE 5, 2500% 15/01/26 144A 2, 474, 910 0.15 USD 2, 252,000 MOSS CREER RE 7, 5000% 15/01/26 144A 2, 474, 910 0.15 USD 2, 525,000 KINETIK HLDIN S, 8750% 15/01/26 144A 2, 474, 910 0.15 USD 2, 600,000 IRON MOUNTAIN 5, 6250% 15/07/32 144A 2, 452, 339 0.15 USD 2, 575,000 CCO HDG LLC/CAP 5, 1259% 01/05/27 144 2, 451, 920 0.15 USD 2, 457,000 CHS/COMMUNITY 8, 0000% 15/03/26 144A 2, 451, 920 0.15 USD 2, 457,000 CHS/COMMUNITY 8, 0000% 15/03/26 144A 2, 450, 567 0.15 USD 2, 575,000 IRON MOUNTAIN 5, 2500% 15/07/30 144A 2, 452, 510 0.15 USD 2, 575,000 SOUTHWESTERN ENE 5, 3750% 15/03/30 2, 429, 419 0, 14 USD 2, 500,000 CKOWN AMERICAS L 5, 2500% 01/04/30 2, 416, 229 0, 14 USD 2, 500,000 CKOWN AMERICAS L 5, 2500% 01/04/30 2, 416, 229 0, 14 USD 2, 500,000 HEALTHEQUITY 4, 5000% 01/07/29 144A 2, 402, 222 0, 14 USD 2, 600,000 HESS MIDSTREA 5, 1250% 15/06/229 144A 2, 391, 999 0, 14 USD 2, 475,000 IRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/03/29 144A 2, 391, 999 0, 14 USD 2, 350,000 IRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/03/29 144A 2, 393, 991 0, 14 USD 2, 475,000 CALPNE CORP 5, 1250% 15/03/29 144A 2, 393, 991 0, 14 USD 2, 475,000 FRONCY K 4, 6250% 15/03/29 144A 2, 393, 991 0, 14 USD 2, 475,000 SEC CORP 5, 1250% 15/03/29 144A 2, 393, 991 0, 14 USD 2, 450,000 FRONTIER CORM 5, 8750% 15/03/29 144A 2, 393, 991 0, 14 USD 2, 250,000 SBA COMMUNICATIO 3, 8750% 15/02/29 144A 2, 376, 040 0, 14 USD 2, 450,000 FRONTIER CORM 5, 8750% 15/02/27 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 450,000 FRONTIER CORM 5, 8750% 15/02/27 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 450,000 FRONTIER CORM 5, 8750% 15/02/27 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 450,000 FRONTIER CORM 5, 8750% 15/02/21 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 250,000 SBA COMMUNICATIO 3, 8750% 15/02/21 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 250,000 TRONK MUNICATIO 3, 8750% 15/02/21 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 250,000 FRONTIER CORM 5, 8750% 16/02/31 144A 2, 256, 154 0, 13 USD 2, 250,000 FRONTIER CORM 5, 8750% 16/02/31 144A 2, 256, 464 0, 13 USD 2, 250,000 FRONTIER CORM 5, 8					
USD 2, 475, 000 GOODYEAR TIRE 5, 2500% 15/07/31 2, 483, 647 0, 15 USD 2, 475, 000 MOSS CREER RE 7, 5000% 15/07/26 144A 2, 474, 910 0, 15 USD 2, 600, 000 IKINETIK HLDIN 5, 8750% 15/06/30 144A 2, 474, 323 0, 15 USD 2, 600, 000 IKINETIK HLDIN 5, 8750% 15/06/30 144A 2, 452, 339 0, 15 USD 2, 575, 000 CCO HDG LLC/CAP 5, 125% 01/05/27 144 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 575, 000 CCO HDG LLC/CAP 5, 125% 01/05/27 144 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 575, 000 CHS/COMMUNITY 8, 0000% 15/07/30 144A 2, 432, 570 0, 14 USD 2, 575, 000 IRON MOUNTAIN 5, 2500% 15/07/30 144A 2, 432, 570 0, 14 USD 2, 525, 000 SUTHWESTERN ENE 5, 3750% 15/03/30 2, 429, 419 0, 14 USD 2, 525, 000 SUTHWESTERN ENE 5, 3750% 15/03/30 2, 429, 419 0, 14 USD 2, 525, 000 SIRIUS XM RAD 5, 5000% 01/07/29 144A 2, 402, 990 0, 14 USD 2, 525, 000 SIRIUS XM RAD 5, 5000% 01/07/29 144A 2, 402, 990 0, 14 USD 2, 525, 000 HEALTHEQUITY 4, 5000% 01/07/29 144A 2, 402, 990 0, 14 USD 2, 475, 000 HESS MIDSTREA 5, 1250% 15/06/28 144A 2, 939, 991 0, 14 USD 2, 350, 000 IRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/02/29 144A 2, 391, 999 0, 14 USD 2, 350, 000 IRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/02/29 144A 2, 391, 999 0, 14 USD 2, 475, 000 CALPINE CORP 5, 1250% 15/03/39 144A 2, 371, 766 0, 14 USD 2, 475, 000 CALPINE COMP 5, 1250% 15/03/29 144A 2, 371, 766 0, 14 USD 2, 242, 250 VERICAST COR 11, 0000% 15/02/27 144A 2, 389, 374 0, 14 USD 2, 250, 000 SBA COMMUNICATIO 3, 8750% 15/03/28 144A 2, 371, 766 0, 14 USD 2, 450, 000 FRONTIER COMP 5, 1250% 16/03/28 144A 2, 371, 766 0, 14 USD 2, 450, 000 FRONTIER COMP 5, 1250% 16/03/29 144A 2, 389, 153 0, 14 USD 2, 250, 000 SBA COMMUNICATIO 3, 8750% 16/10/27 144A 2, 389, 153 0, 14 USD 2, 250, 000 SER COMM SERVICE CORP 5, 1250% 16/03/39 144A 2, 389, 153 0, 14 USD 2, 250, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 16/06/29 2, 388, 307 0, 14 USD 2, 250, 000 FREFORMANCE F 4, 2500% 16/06/29 2, 388, 307 0, 14 USD 2, 250, 000 FREFORMANCE F 4, 2500% 16/06/29 144A 2, 389, 153 0, 14 USD 2, 250, 000 FREFORMANCE F 4, 2500% 16/06/29 144A 2, 389, 159 0, 14 USD 2, 250, 000 FREFORMANCE F 4, 2500% 16/06/29 144A 2, 26, 46, 64					
USD 2, 475, 000 MOSS CREEK R 7, 5000% 15/01/26 144A 2, 474, 910 0, 15 USD 2, 525, 000 KINETIK HLDIN 5, 87550% 15/06/30 144A 2, 474, 923 0, 15 USD 2, 5600, 000 IRON MOUNTAIN 5, 6250% 15/07/32 144A 2, 452, 339 0, 15 USD 2, 575, 000 CCO HDG LLC/CAP 5, 1259% 11/05/27 144A 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 457, 000 CHS/COMMUNITY 8, 0000% 15/03/26 144A 2, 450, 567 0, 15 USD 2, 575, 000 IRON MOUNTAIN 5, 2500% 15/07/30 144A 2, 432, 570 0, 14 USD 2, 575, 000 SOUTHWESTERN ENE 5, 3750% 15/03/30 2, 429, 419 0, 14 USD 2, 552, 000 SOUTHWESTERN ENE 5, 3750% 15/03/30 2, 429, 419 0, 14 USD 2, 500, 000 CROWN AMERICAS L 5, 2500% 01/04/30 2, 416, 929 0, 14 USD 2, 550, 000 SIRIUS XM RAD 5, 50000% 01/10/29 144A 2, 402, 292 0, 14 USD 2, 475, 000 HEALTHEQUITY 4, 5000% 01/10/29 144A 2, 402, 292 0, 14 USD 2, 475, 000 HESS MIDSTREA 5, 1250% 15/06/28 144A 2, 391, 999 0, 14 USD 2, 450, 000 IRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/02/29 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 455, 000 CROWN NC 4, 6250% 15/03/29 144A 2, 389, 374 0, 14 USD 2, 475, 000 CALPINE CORP 5, 1250% 15/06/29 144A 2, 389, 374 0, 14 USD 2, 475, 000 CALPINE CORP 5, 1250% 15/03/28 144A 2, 389, 374 0, 14 USD 2, 232, 250 VERICAST COR 11, 0000% 15/02/29 144A 2, 376, 040 0, 14 USD 2, 250, 000 FRONTURE CORP 5, 1250% 15/03/29 144A 2, 389, 374 0, 14 USD 2, 450, 000 FRONTURE CORP 5, 1250% 15/03/29 144A 2, 389, 374 0, 14 USD 2, 450, 000 FRONTURE CORP 5, 1250% 15/03/29 144A 2, 389, 374 0, 14 USD 2, 450, 000 FRONTURE COM 5, 8750% 15/03/29 144A 2, 389, 373 0, 14 USD 2, 460, 000 FRONTURE COM 5, 8750% 15/03/29 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 460, 000 FRONTURE COM 5, 8750% 15/03/29 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 460, 000 FRONTURE COM 5, 8750% 15/03/29 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 460, 000 FRONTURE COM 5, 8750% 15/03/29 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 460, 000 FRONTURE COM 5, 8750% 15/03/29 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 460, 000 FRONTURE COM 5, 8750% 15/03/29 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 250, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 10/06/29 2, 388, 307 0, 14 USD 2, 250, 000 FRONTURE COM 5, 8750% 15/03/29 144A 2, 269, 656 0, 14 USD 2, 250,					
USD 2, 525, 000 KINETIK HLDIN 5, 8750% 15/06/30 144A 2, 474, 323 0, 15 USD 2, 600, 000 1RON MOUNTAIN 5, 6250% 15/07/32 144A 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 575, 000 CCO HDG LLC/CAP 5, 125% 01/05/27 144 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 457, 000 CHS/COMMUNITY 8, 0000% 15/03/26 144A 2, 450, 567 0, 15 USD 2, 575, 000 IRON MOUNTAIN 5, 2500% 15/07/30 144A 2, 452, 570 0, 14 USD 2, 525, 000 SOUTHWESTERN ENE 5, 3750% 15/03/30 2, 416, 929 0, 14 USD 2, 500, 000 CROWN AMERICAS L 5, 2560% 01/04/30 2, 416, 929 0, 14 USD 2, 500, 000 CROWN AMERICAS L 5, 2560% 01/04/30 2, 416, 929 0, 14 USD 2, 500, 000 FROWN MOUNTAIN 5, 0000% 01/07/29 144A 2, 402, 990 0, 14 USD 2, 505, 000 SIRIUS XM RAD 5, 50009% 01/07/29 144A 2, 402, 990 0, 14 USD 2, 475, 000 HEALTHEQUITY 4, 5000% 01/07/29 144A 2, 402, 990 0, 14 USD 2, 350, 000 IRON MOUNTAIN 7, 0000% 01/07/29 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 350, 000 TRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/06/28 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 350, 000 TRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/06/28 144A 2, 319, 099 0, 14 USD 2, 350, 000 TRONOX INC 4, 6250% 15/03/28 144A 2, 319, 099 0, 14 USD 2, 475, 000 CALPINE CORP 5, 1250% 15/03/28 144A 2, 376, 040 0, 14 USD 2, 475, 000 CALPINE CORP 5, 1250% 15/03/28 144A 2, 371, 766 0, 14 USD 2, 450, 000 FRONTIER CORM 5, 8750% 15/03/28 144A 2, 371, 766 0, 14 USD 2, 450, 000 FRONTIER CORM 5, 8750% 15/03/28 144A 2, 371, 766 0, 14 USD 2, 450, 000 SBA COMMUNICATIO 3, 8750% 15/02/27 2, 368, 307 0, 14 USD 2, 350, 000 NUSTAR LOGISTICS 6, 3750% 01/10/30 2, 363, 487 0, 14 USD 2, 463, 000 NEW ENTERPRIS 5, 2560% 15/02/27 2, 368, 303, 487 0, 14 USD 2, 465, 000 PERFORMANCE F 4, 2500% 15/06/29 2, 358, 773 0, 14 USD 2, 465, 000 PERFORMANCE F 4, 2500% 15/06/29 2, 358, 773 0, 14 USD 2, 260, 000 REON MOUNTAIN 4, 5000% 15/06/29 4, 2, 356, 786 0, 14 USD 2, 255, 000 PERFORMANCE F 1, 2500% 01/06/29 4, 2, 356, 786 0, 14 USD 2, 255, 000 PERFORMANCE F 1, 2500% 01/06/29 4, 2, 356, 786 0, 14 USD 2, 255, 000 PERFORMANCE F 1, 2500% 01/06/29 4, 2, 356, 786 0, 14 USD 2, 255, 000 PERFORMANCE F 1, 2500% 01/06/29 4, 2, 255, 290 0, 13 USD 2, 255, 000 PERFO					
USD 2, 600, 000 IRON MOUNTAIN 5, 6250% 15/07/32 144A 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 575, 000 CCO HDG LLC/CAP 5, 1259% 01/05/27 144 2, 451, 920 0, 15 USD 2, 457, 000 IRON MOUNTAIN 5, 2500% 15/03/26 144A 2, 450, 567 0, 15 USD 2, 575, 000 IRON MOUNTAIN 5, 2500% 15/03/30 144A 2, 450, 567 0, 15 USD 2, 525, 000 SOUTHWESTERN ENE 5, 3750% 15/03/30 2, 429, 419 0, 14 USD 2, 525, 000 CROWN AMERICAS L 5, 2500% 01/04/30 2, 416, 929 0, 14 USD 2, 525, 000 SIRIUS XM RAD 5, 50009% 01/04/30 2, 416, 929 0, 14 USD 2, 525, 000 SIRIUS XM RAD 5, 50009% 01/10/29 144A 2, 402, 990 0, 14 USD 2, 475, 000 HEALTHEQUITY 4, 5000% 01/10/29 144A 2, 402, 922 0, 14 USD 2, 475, 000 HEASMIDSTREA 5, 1250% 15/06/28 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 350, 000 IRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/02/29 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 350, 000 IRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/02/29 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 475, 000 CALPINE CORP 5, 1250% 15/03/28 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 232, 250 VERICAST COR 11, 0000% 15/02/29 144A 2, 399, 374 0, 14 USD 2, 475, 000 FRONTIER CORP 5, 1250% 15/03/28 144A 2, 376, 040 0, 14 USD 2, 2450, 000 FRONTIER CORP 5, 1250% 15/03/28 144A 2, 376, 040 0, 14 USD 2, 2500, 000 SBA COMMUNICATIO 3, 8750% 15/10/27 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 500, 000 SBA COMMUNICATIO 3, 8750% 15/10/27 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 500, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 16/03/28 144A 2, 376, 040 0, 14 USD 2, 463, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 16/03/28 144A 2, 376, 040 1, 14 USD 2, 463, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 16/03/29 144A 2, 386, 307 0, 14 USD 2, 463, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 16/03/29 144A 2, 362, 753 0, 14 USD 2, 463, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 16/03/29 144A 2, 366, 786 0, 14 USD 2, 575, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 16/03/29 144A 2, 386, 786 0, 14 USD 2, 2500, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 16/03/29 144A 2, 386, 786 0, 14 USD 2, 2500, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 16/03/30 144A 2, 326, 566 0, 14 USD 2, 2500, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 16/03/30 144A 2, 226, 664 0, 13 USD 2, 255, 000 SIZLING PIAT 8, 5000% 16/03/29 144A 2, 236, 644 0, 13 USD 2, 250, 000 SIZLING PIAT 8, 5000% 16/03/29 144A 2, 286, 965 0,					
USD 2, 575, 000 CCO HDG LLC/CAP 5, 125% 01/05/27 144					
USD 2, 457, 000 CHS/COMMUNITY 8, 0000% 15/03/26 144A 2, 450, 567 0.15 USD 2, 575, 000 IRON MOUNTAIN 5, 2500% 15/07/30 144A 2, 432, 570 0.14 USD 2, 550, 000 CROWN AMERICAS L 5, 2500% 10/04/30 2, 416, 929 0.14 USD 2, 550, 000 CROWN AMERICAS L 5, 2500% 01/04/30 2, 416, 929 0.14 USD 2, 550, 000 HESMIDS MR AD 5, 5000% 01/07/29 144A 2, 402, 990 0.14 USD 2, 660, 000 HESMIDSTREA 5, 1250% 16/06/28 144A 2, 933, 991 0.14 USD 2, 475, 000 HESS MIDSTREA 5, 1250% 15/06/28 144A 2, 393, 991 0.14 USD 2, 350, 000 IRON MOUNTAIN 7, 0000% 01/10/29 144A 2, 393, 991 0.14 USD 2, 350, 000 IRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/02/29 144A 2, 391, 099 0.14 USD 2, 475, 000 CALPINE CORP 5, 1250% 15/03/29 144A 2, 391, 099 0.14 USD 2, 475, 000 CALPINE CORP 5, 1250% 15/03/28 144A 2, 371, 766 0.14 USD 2, 475, 000 CALPINE CORP 5, 1250% 15/03/28 144A 2, 371, 766 0.14 USD 2, 232, 250 VERICAST COR 11, 0000% 15/09/26 144A 2, 371, 766 0.14 USD 2, 450, 000 FRONTIER COMM 5, 87509 15/10/27 144A 2, 369, 153 0.14 USD 2, 500, 000 SBA COMMUNICATIO 3, 8750% 15/02/27 2, 368, 307 0.14 USD 2, 500, 000 NUSTAR LOGISTICS 6, 3750% 01/10/30 2, 363, 487 0.14 USD 2, 463, 000 NEW ENTERPRIS 5, 2500% 15/07/28 144A 2, 362, 753 0.14 USD 2, 463, 000 NEW ENTERPRIS 5, 2500% 15/07/28 144A 2, 362, 753 0.14 USD 2, 463, 000 NEW ENTERPRIS 5, 2500% 15/07/28 144A 2, 362, 753 0.14 USD 2, 250, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 01/06/29 2, 358, 773 0.14 USD 2, 260, 000 AMERICAN AIRL 8, 5000% 15/06/29 144A 2, 354, 919 0.14 USD 2, 250, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 01/06/29 144A 2, 354, 919 0.14 USD 2, 500, 000 TRONOM DID 6, 0000% 01/06/29 144A 2, 364, 919 0.14 USD 2, 250, 000 TRONOM DID 6, 0000% 01/06/29 144A 2, 236, 138, 124 0.14 USD 2, 250, 000 SIZZLING PLAT 8, 5000% 15/06/29 144A 2, 236, 935 0.14 USD 2, 250, 000 THOR INDUSTRI 4, 0000% 15/09/31 144A 2, 226, 664 0.13 USD 2, 250, 000 THOR INDUSTRI 4, 0000% 15/01/30 144A 2, 226, 664 0.13 USD 2, 250, 000 SIZZLING PLAT 8, 5000% 15/05/29 144A 2, 226, 664 0.13 USD 2, 250, 000 SIZZLING PLAT 8, 5000% 15/05/29 144A 2, 226, 664 0.13 USD 2, 250, 000 SIZZLING PLAT 8, 5000					
USD 2,575,000 IRON MOUNTAIN 5,2500% 15/07/30 144A 2,432,570 0.14 USD 2,500,000 CORDWN AMERICAS L 5,2500% 01/04/30 2,416,929 0.14 USD 2,500,000 CROWN AMERICAS L 5,2500% 01/04/30 2,416,929 0.14 USD 2,525,000 SIRIUS XM RAD 5,5000% 01/07/29 144A 2,402,990 0.14 USD 2,600,000 HEALTHEQUITY 4,5000% 01/10/29 144A 2,402,990 0.14 USD 2,475,000 HESS MIDSTREA 5,1250% 15/06/28 144A 2,393,991 0.14 USD 2,450,000 IRON MOUNTAIN 7,0000% 15/02/29 144A 2,391,999 0.14 USD 2,450,000 TRONO MOUNTAIN 7,0000% 15/02/29 144A 2,391,999 0.14 USD 2,450,000 TRONO MOUNTAIN 7,0000% 15/02/29 144A 2,391,999 0.14 USD 2,450,000 TRONO MOUNTAIN 7,0000% 15/02/29 144A 2,391,999 0.14 USD 2,450,000 FRONTIER CORP 5,1250% 15/03/28 144A 2,376,040 0.14 USD 2,232,250 VERICAST COR 11,0000% 15/09/26 144A 2,371,766 0.14 USD 2,250,000 FRONTIER COMP 5,8750% 15/10/27 144A 2,369,153 0.14 USD 2,450,000 FRONTIER COMP 5,8750% 15/02/27 2,368,307 0.14 USD 2,450,000 SBA COMMUNICATIO 3,8750% 15/02/27 2,368,307 0.14 USD 2,350,000 NUSTAR LOGISTICS 6,3750% 01/10/30 2,363,487 0.14 USD 2,450,000 SERVICE CORP 5,1250% 01/06/29 2,358,773 0.14 USD 2,450,000 SERVICE CORP 5,1250% 01/06/29 2,358,773 0.14 USD 2,450,000 PERFORMANCE F 4,2500% 01/08/29 144A 2,362,753 0.14 USD 2,200,000 AMERICAN AIR. 8,5000% 15/02/31 144A 2,334,919 0.14 USD 2,200,000 AMERICAN AIR. 8,5000% 15/02/31 144A 2,334,919 0.14 USD 2,200,000 AMERICAN AIR. 8,5000% 15/02/31 144A 2,334,919 0.14 USD 2,250,000 OUTFRONT MEDI 4,6250% 15/03/30 144A 2,279,617 0.14 USD 2,550,000 OUTFRONT MEDI 4,6250% 15/03/30 144A 2,260,653 0.14 USD 2,550,000 OUTFRONT MEDI 4,6250% 15/03/30 144A 2,260,653 0.14 USD 2,250,000 AMERICAN AIR. 8,5000% 15/05/29 144A 2,260,653 0.14 USD 2,250,000 OUTFRONT MEDI 4,6250% 15/03/30 144A 2,260,653 0.14 USD 2,250,000 OUTFRONT MEDI 4,6250% 15/03/30 144A 2,260,653 0.14 USD 2,250,000 OUTFRONT MEDI 7,3750% 01/06/25 144A 2,260,653 0.14 USD 2,250,000 OUTFRONT MEDI 7,3750% 01/06/29 144A 2,264,664 0.13 USD 2,250,000 OUTFRONT MEDI 7,3750% 01/06/27 144A 2,264,664 0.13 USD 2,250,000 OUTFRONT MEDI 7,3750% 01/06/27 144A 2,2					
USD 2, 525, 000 SUTHWESTERN ENE 5, 3750% 15/03/30 2, 429, 419 0, 14 USD 2, 500, 000 CROWN AMERICAS L. 5, 2500% 01/04/30 2, 416, 929 0, 14 USD 2, 600, 000 HEALTHEQUITY 4, 5000% 01/10/29 144A 2, 402, 292 0, 14 USD 2, 475, 000 HESS MIDSTREA 5, 1250% 15/06/28 144A 2, 393, 991 0, 14 USD 2, 475, 000 HESS MIDSTREA 5, 1250% 15/06/28 144A 2, 393, 991 0, 14 USD 2, 350, 000 IRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/02/29 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 450, 000 TRONOX INC 4, 6250% 15/03/29 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 475, 000 CALPINE CORP 5, 1250% 15/03/29 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 475, 000 CALPINE CORP 5, 1250% 15/03/29 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 475, 000 CALPINE CORP 5, 1250% 15/03/29 144A 2, 371, 766 0, 14 USD 2, 450, 000 FRONTIER COMM 5, 8750% 15/03/29 144A 2, 371, 766 0, 14 USD 2, 500, 000 SBA COMMUNICATIO 3, 8750% 15/10/27 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 500, 000 NUSTAR LOGISTICS 6, 3750% 01/10/30 2, 363, 487 0, 14 USD 2, 463, 000 NEW ENTERPRIS 5, 2500% 15/03/28 144A 2, 362, 753 0, 14 USD 2, 425, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 01/06/29 2, 358, 773 0, 14 USD 2, 425, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 01/06/29 2, 358, 773 0, 14 USD 2, 500, 000 SERVICE CORP 5, 1550% 01/06/29 2, 358, 773 0, 14 USD 2, 500, 000 SERVICE CORP 5, 1650% 10/06/29 2, 358, 773 0, 14 USD 2, 500, 000 SERVICE CORP 5, 1650% 10/06/29 4, 334, 919 0, 14 USD 2, 500, 000 SERVICE CORP 5, 1650% 10/06/29 4, 358, 786 0, 14 USD 2, 500, 000 CRESTWOOD MID 6, 0000% 01/02/29 144A 2, 336, 786 0, 14 USD 2, 550, 000 OUTFRONT MEDI 4, 6250% 15/03/30 144A 2, 269, 053 0, 14 USD 2, 550, 000 OUTFRONT MEDI 4, 6250% 15/03/30 144A 2, 269, 653 0, 14 USD 2, 550, 000 SIZZLING PLAT 8, 5000% 28/11/25 144A 2, 269, 654 0, 14 USD 2, 550, 000 SIZZLING PLAT 8, 5000% 28/11/25 144A 2, 269, 654 0, 14 USD 2, 550, 000 OUTFRONT MEDI 4, 6250% 15/03/30 144A 2, 246, 664 0, 13 USD 2, 250, 000 FRONT MEDI 4, 6250% 15/07/32 144A 2, 269, 654 0, 14 USD 2, 250, 000 SIZZLING PLAT 8, 5000% 61/02/29 144A 2, 269, 654 0, 13 USD 2, 250, 000 SIZZLING PLAT 8, 5000% 61/02/29 144A 2, 269, 654 0, 13 USD 2, 250, 000 SIZZLING PLAT 8, 500					
USD 2,500,000 CROWN AMERICAS L 5,2500% 01/04/30 2,416,929 0.14 USD 2,525,000 SIRIUS XM RAD 5,5000% 01/07/29 144A 2,402,990 0.14 USD 2,600,000 HEALTHEQUITY 4,5000% 01/10/29 144A 2,402,222 0.14 USD 2,475,000 HESS MIDSTREA 5,1250% 15/06/28 144A 2,393,991 0.14 USD 2,350,000 IRON MOUNTAIN 7,0000% 15/02/29 144A 2,393,991 0.14 USD 2,550,000 TRONOX INC 4,6250% 15/03/29 144A 2,393,974 0.14 USD 2,475,000 CALPINE CORP 5,1250% 15/03/29 144A 2,393,374 0.14 USD 2,475,000 CALPINE CORP 5,1250% 15/03/29 144A 2,376,040 0.14 USD 2,232,250 VERICAST COR 11,0000% 15/09/26 144A 2,371,766 0.14 USD 2,450,000 FRONTIER COMM 5,8750% 15/10/27 144A 2,369,153 0.14 USD 2,500,000 SBA COMMUNICATIO 3,8750% 15/10/27 144A 2,369,153 0.14 USD 2,500,000 NUSTAR LOGISTICS 6,3750% 01/10/30 2,363,487 0.14 USD 2,463,000 NEW ENTERPRIS 5,2500% 15/07/28 144A 2,362,553 0.14 USD 2,463,000 NEW ENTERPRIS 5,2500% 15/07/28 144A 2,362,553 0.14 USD 2,463,000 NEW ENTERPRIS 5,2500% 15/07/28 144A 2,362,753 0.14 USD 2,260,000 RON MOUNTAIN 4,5000% 15/06/29 2,358,773 0.14 USD 2,260,000 RON MOUNTAIN 4,5000% 15/06/29 144A 2,366,756 0.14 USD 2,200,000 AMERICAN AIRL 8,5000% 15/06/29 144A 2,356,786 0.14 USD 2,200,000 CRESTWOOD MID 6,0000% 01/02/29 144A 2,334,919 0.14 USD 2,250,000 SIZZLING PLAT 8,5000% 15/06/29 144A 2,231,124 0.14 USD 2,550,000 SIZLING PLAT 8,5000% 28/11/25 144A 2,233,213 0.14 USD 2,550,000 SIZLING PLAT 8,5000% 28/11/25 144A 2,233,213 0.13 USD 2,250,000 CRESTWOOD MID 6,0000% 01/02/29 144A 2,253,213 0.13 USD 2,250,000 FLAT 8,5000% 15/06/25 144A 2,264,664 0.13 USD 2,250,000 FROM SEC/FIN 3,3750% 01/06/25 144A 2,228,900 0.13 USD 2,250,000 FROM SEC/FIN 3,3750% 01/06/25 144A 2,228,900 0.13 USD 2,250,000 FROM SEC/FIN 3,3750% 01/06/25 144A 2,226,154 0.13 USD 2,250,000 FROM SEC/FIN 3,3750% 01/06/25 144A 2,226,164 0.13 USD 2,250,000 FROM SEC/FIN 3,3750% 01/06/25 144A 2,226,164 0.13 USD 2,200,000 CRESTWOOD MID 7,3750% 01/06/25 144A 2,226,164 0.13 USD 2,200,000 CRESTWOOD MID 7,3750% 01/06/25 144A 2,226,164 0.13 USD 2,200,000 CRESTWOOD MID 7,3750% 01/06/27 WI 2,208,755 0.1					
USD 2,525,000 SIRIUS XM RAD 5,5000% 01/07/29 144A 2,402,990 0.14 USD 2,600,000 HEALTHEQUITY 4,5000% 01/10/29 144A 2,402,222 0.14 USD 2,475,000 HESS MIDSTREA 5,1250% 15/06/28 144A 2,393,991 0.14 USD 2,350,000 IRON MOUNTAIN 7.0000% 15/02/29 144A 2,391,099 0.14 USD 2,650,000 TRONOX INC 4,6250% 15/03/29 144A 2,391,099 0.14 USD 2,475,000 CALPINE CORP 5,1250% 15/03/28 144A 2,371,766 0.14 USD 2,232,250 VERICAST COR 11,0000% 15/09/26 144A 2,371,766 0.14 USD 2,232,250 VERICAST COR 11,0000% 15/09/26 144A 2,371,766 0.14 USD 2,450,000 FRONTIER COMM 5,8750% 15/10/27 144A 2,369,153 0.14 USD 2,500,000 SBA COMMUNICATIO 3,8750% 15/02/27 2,368,307 0.14 USD 2,500,000 NUSTAR LOGISTICS 6,3750% 01/10/30 2,363,487 0.14 USD 2,463,000 NEW ENTERPRIS 5,2500% 15/07/28 144A 2,362,753 0.14 USD 2,463,000 NEW ENTERPRIS 5,2500% 15/07/28 144A 2,362,753 0.14 USD 2,463,000 PERFORMANCE F 4,2500% 01/06/29 2,358,773 0.14 USD 2,575,000 PERFORMANCE F 4,2500% 01/08/29 144A 2,356,786 0.14 USD 2,600,000 IRON MOUNTAIN 4,5000% 15/05/29 144A 2,334,919 0.14 USD 2,200,000 AMERICAN AIRL 8,5000% 15/05/29 144A 2,334,919 0.14 USD 2,200,000 CRESTWOOD MID 6,0000% 01/02/29 144A 2,318,124 0.14 USD 2,550,000 OUTFRONT MEDI 4,6250% 15/03/30 144A 2,279,617 0.14 USD 2,500,000 ADT CORP 4,8750% 15/07/32 144A 2,269,053 0.14 USD 2,500,000 THOR INDUSTRI 4,5000% 15/05/29 144A 2,253,213 0.13 USD 2,250,000 THOR INDUSTRI 4,0000% 15/10/29 144A 2,253,213 0.13 USD 2,250,000 CCRESTWOOD MID 7,3750% 01/06/25 144A 2,226,4664 0.13 USD 2,250,000 FROM THOLDINGS 7,3750% 01/06/25 144A 2,225,449 0.13 USD 2,250,000 CCRESTWOOD MID 7,3750% 01/06/29 144A 2,225,449 0.13 USD 2,250,000 CCRESTWOOD MID 7,3750% 01/06/25 144A 2,225,449 0.13 USD 2,250,000 CRESTWOOD MID 7,3750% 01/06/25 144A 2,225,449 0.13 USD 2,250,000 CCRESTWOOD MID 7,3750% 01/06/25 144A 2,225,449 0.13 USD 2,200,000 VENTURE GLOBA 6,2500% 15/01/30 144A 2,225,449 0.13 USD 2,200,000 VENTURE GLOBA 6,2500% 15/01/30 144A 2,225,449 0.13 USD 2,200,000 CCRCHOLDINGS 17,7500% 01/06/27 WI 2,208,755 0.13 USD 2,200,000 CCRCHOLDINGS 17,7500% 01/06/27 W					
USD 2,600,000 HEALTHEQUITY 4,5000% 01/10/29 144A 2,402,222 0.14 USD 2,475,000 HESS MIDSTREA 5.1250% 15/06/28 144A 2,393,991 0.14 USD 2,350,000 IRON MOUNTAIN 7.0000% 15/02/29 144A 2,391,099 0.14 USD 2,650,000 TRONOX INC 4.6250% 15/03/29 144A 2,391,099 0.14 USD 2,475,000 CALPINE CORP 5.1250% 15/03/29 144A 2,389,374 0.14 USD 2,2475,000 CALPINE CORP 5.1250% 15/03/29 144A 2,371,766 0.14 USD 2,2450,000 FRONTIER COMM 5.8750% 15/02/27 144A 2,371,766 0.14 USD 2,450,000 SBA COMMUNICATIO 3.8750% 15/02/27 2,368,307 0.14 USD 2,500,000 SBA COMMUNICATIO 3.8750% 15/02/27 2,368,307 0.14 USD 2,350,000 NEW ENTERPRIS 5.2500% 15/07/28 144A 2,369,153 0.14 USD 2,460,000 NEW ENTERPRIS 5.2500% 15/07/28 144A 2,362,753 0.14 USD 2,450,000 SERVICE CORP 5.1250% 01/06/29 2,358,773 0.14 USD 2,2575,000 SERVICE CORP 5.1250% 01/06/29 2,358,773 0.14 USD 2,575,000 IRON MOUNTAIN 4.5000% 15/02/21 144A 2,362,753 0.14 USD 2,250,000 REON MOUNTAIN 4.5000% 15/02/21 144A 2,334,919 0.14 USD 2,250,000 CRESTWOOD MID 6.0000% 01/08/29 144A 2,344,919 0.14 USD 2,250,000 ORESTWOOD MID 6.0000% 01/02/29 144A 2,344,919 0.14 USD 2,250,000 SIZZLING PLAT 8.5000% 01/06/29 144A 2,344,919 0.14 USD 2,250,000 ADT CORP 4.8750% 15/07/23 144A 2,269,053 0.14 USD 2,250,000 ADT CORP 4.8750% 15/07/32 144A 2,269,053 0.14 USD 2,250,000 ADT CORP 4.8750% 15/07/32 144A 2,269,053 0.14 USD 2,250,000 ADT CORP 4.8750% 15/07/32 144A 2,269,053 0.14 USD 2,250,000 ADT CORP 4.8750% 15/07/32 144A 2,269,053 0.14 USD 2,250,000 ADT CORP 7.8750% 15/07/31 144A 2,269,053 0.14 USD 2,250,000 ADT CORP 7.8750% 15/07/31 144A 2,269,053 0.14 USD 2,250,000 ADT CORP 7.8750% 15/07/31 144A 2,269,053 0.14 USD 2,250,000 ADT CORP 7.8750% 15/07/31 144A 2,269,053 0.14 USD 2,250,000 ADT CORP 7.8750% 15/07/31 144A 2,269,053 0.14 USD 2,250,000 ADT CORP 7.8750% 15/07/31 144A 2,269,053 0.13 USD 2,260,000 CRESTWOOD MID 7.3750% 01/06/27 144A 2,269,053 0.13 USD 2,200,000 CRESTWOOD MID 7.3750% 01/02/31 144A 2,269,053 0.13 USD 2,200,000 CRESTWOOD MID 7.3750% 01/02/31 144A 2,269,053 0.13 USD 2,200,000 CRESTWOOD MID 7.3750% 01/0					
USD					
USD 2, 350, 000 IRON MOUNTAIN 7, 0000% 15/02/29 144A 2, 391, 099 0, 14 USD 2, 650, 000 TRONOX INC 4, 6250% 15/03/29 144A 2, 389, 374 0, 14 USD 2, 475, 000 CALPINE CORP 5, 1250% 15/03/29 144A 2, 376, 040 0, 14 USD 2, 232, 250 VERICAST COR 11, 0000% 15/09/26 144A 2, 371, 766 0, 14 USD 2, 450, 000 FRONTIER COMM 5, 8750% 15/10/27 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 500, 000 SBA COMMUNICATIO 3, 8750% 15/10/27 2, 368, 307 0, 14 USD 2, 500, 000 NUSTAR LOGISTICS 6, 3750% 01/10/30 2, 363, 487 0, 14 USD 2, 463, 000 NEW ENTERPRIS 5, 2500% 10/06/29 2, 368, 773 0, 14 USD 2, 463, 000 NEW ENTERPRIS 5, 2500% 01/10/30 2, 368, 773 0, 14 USD 2, 425, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 01/06/29 2, 358, 773 0, 14 USD 2, 425, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 01/08/29 144A 2, 362, 753 0, 14 USD 2, 450, 000 IRON MOUNTAIN 4, 5000% 15/05/29 144A 2, 366, 786 0, 14 USD 2, 200, 000 IRON MOUNTAIN 4, 5000% 15/05/29 144A 2, 334, 919 0, 14 USD 2, 200, 000 AMERICAN AIRL 8, 5000% 15/05/29 144A 2, 334, 919 0, 14 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 6, 0000% 01/02/29 144A 2, 318, 124 0, 14 USD 2, 550, 000 UTFRONT MEDI 4, 6250% 15/03/30 144A 2, 318, 124 0, 14 USD 2, 550, 000 UTFRONT MEDI 4, 6250% 15/03/30 144A 2, 269, 053 0, 14 USD 2, 550, 000 UTFRONT MEDI 4, 6250% 15/03/30 144A 2, 269, 053 0, 14 USD 2, 250, 000 SIZZLING PLAT 8, 5000% 28/11/25 144A 2, 269, 053 0, 14 USD 2, 250, 000 MD 6, 0000% 01/06/25 144A 2, 269, 053 0, 14 USD 2, 250, 000 MD 6, 0000% 01/06/25 144A 2, 269, 053 0, 14 USD 2, 250, 000 MD 6, 0000% 01/06/25 144A 2, 269, 053 0, 14 USD 2, 250, 000 MID 10/08/30 14/40 2, 253, 213 0, 13 USD 2, 250, 000 PRIME SEC/FIN 3, 3750% 01/06/25 144A 2, 225, 469 0, 13 USD 2, 250, 000 CRESTWOOD MID 7, 3750% 01/06/25 144A 2, 225, 449 0, 13 USD 2, 250, 000 CRESTWOOD MID 7, 3750% 01/06/25 144A 2, 225, 449 0, 13 USD 2, 250, 000 CRESTWOOD MID 7, 3750% 01/06/25 144A 2, 225, 449 0, 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7, 3750% 01/06/27 144A 2, 225, 449 0, 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7, 3750% 01/06/27 144A 2, 225, 449 0, 13 USD 2, 275, 000 SEALED AIR/US 7, 2500% 15/01/30 144A 2, 225, 449 0					
USD 2, 650, 000 TRONOX INC 4, 6250% 15/03/29 144A 2, 389, 374 0, 14 USD 2, 475, 000 CALPINE CORP 5, 1250% 15/03/28 144A 2, 376, 040 0, 14 USD 2, 232, 250 VERICAST COR 11, 0000% 15/09/26 144A 2, 371, 766 0, 14 USD 2, 450, 000 FRONTIER COMM 5, 8750% 15/10/27 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 500, 000 SBA COMMUNICATIO 3, 8750% 15/10/27 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 350, 000 NUSTAR LOGISTICS 6, 3750% 01/10/30 2, 363, 487 0, 14 USD 2, 463, 000 NEW ENTERPRIS 5, 2500% 15/07/28 144A 2, 362, 753 0, 14 USD 2, 463, 000 NEW ENTERPRIS 5, 2500% 15/07/28 144A 2, 362, 753 0, 14 USD 2, 455, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 01/06/29 2, 358, 773 0, 14 USD 2, 575, 000 PERFORMANCE F 4, 2500% 01/08/29 144A 2, 356, 786 0, 14 USD 2, 500, 000 RRON MOUNTAIN 4, 5000% 15/02/31 144A 2, 334, 919 0, 14 USD 2, 200, 000 AMERICAN AIRL 8, 5000% 15/02/21 144A 2, 334, 919 0, 14 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 6, 0000% 01/02/29 144A 2, 318, 124 0, 14 USD 2, 350, 000 CRESTWOOD MID 6, 0000% 01/02/29 144A 2, 318, 124 0, 14 USD 2, 250, 000 SIZZLING PLAT 8, 5000% 28/11/25 144A 2, 269, 653 0, 14 USD 2, 250, 000 SIZZLING PLAT 8, 5000% 28/11/25 144A 2, 269, 653 0, 14 USD 2, 250, 000 GRAY TELE INC 7, 0000% 15/05/27 144A 2, 253, 213 0, 13 USD 2, 245, 000 PRIME SEC/FIN 3, 3750% 01/08/27 144A 2, 228, 900 0, 13 USD 2, 255, 000 PRIME SEC/FIN 3, 3750% 01/08/27 144A 2, 228, 900 0, 13 USD 2, 245, 000 PRIME SEC/FIN 3, 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0, 13 USD 2, 255, 000 SOUTHWESTER N 5, 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0, 13 USD 2, 255, 000 SOUTHWESTER N F), 5750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0, 13 USD 2, 255, 000 SOUTHWESTERN N S, 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0, 13 USD 2, 275, 000 SOUTHWESTERN N S, 3750% 01/02/31 144A 2, 208, 755 0, 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7, 3750% 01/02/31 144A 2, 208, 755 0, 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7, 3750% 01/02/31 144A 2, 208, 755 0, 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7, 3750% 01/02/31 144A 2, 208, 755 0, 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7, 3750% 01/02/31 144A 2, 208, 755 0, 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7, 3750% 01/06/27 WI 2, 208, 755 0					
USD 2, 475, 000 CALPINE CORP 5, 1250% 15/03/28 144A 2, 376, 040 0, 14 USD 2, 232, 250 VERICAST COR 11, 0000% 15/09/26 144A 2, 371, 766 0, 14 USD 2, 450, 000 FRONTIER COMM 5, 8750% 15/10/27 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 500, 000 SBA COMMUNICATIO 3, 8750% 15/02/27 2, 368, 307 0, 14 USD 2, 350, 000 NUSTAR LOGISTICS 6, 3750% 01/10/30 2, 363, 487 0, 14 USD 2, 463, 000 NEW ENTERPRIS 5, 2500% 01/07/28 144A 2, 362, 753 0, 14 USD 2, 463, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 01/06/29 2, 358, 773 0, 14 USD 2, 2425, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 01/06/29 2, 358, 773 0, 14 USD 2, 575, 000 PERFORMANCE F 4, 2500% 01/08/29 144A 2, 356, 786 0, 14 USD 2, 600, 000 IRON MOUNTAIN 4, 5000% 15/02/31 144A 2, 334, 919 0, 14 USD 2, 200, 000 AMERICAN AIRL 8, 5000% 15/05/29 144A 2, 320, 556 0, 14 USD 2, 300, 000 CRESTWOOD MID 6, 0000% 01/02/29 144A 2, 318, 124 0, 14 USD 2, 550, 000 OUTFRONT MEDI 4, 6250% 15/03/30 144A 2, 279, 617 0, 14 USD 2, 250, 000 SIZZLING PLAT 8, 5000% 28/11/25 144A 2, 269, 053 0, 14 USD 2, 250, 000 ADT CORP 4, 8750% 15/07/32 144A 2, 264, 664 0, 13 USD 2, 255, 000 NMI HOLDINGS 7, 3750% 01/06/25 144A 2, 264, 664 0, 13 USD 2, 250, 000 THOR INDUSTRI 4, 0000% 15/05/27 144A 2, 264, 894 0, 13 USD 2, 250, 000 FRIME SEC/FIN 3, 3750% 01/06/25 144A 2, 225, 3213 0, 13 USD 2, 250, 000 PRIME SEC/FIN 3, 3750% 01/06/25 144A 2, 225, 449 0, 13 USD 2, 250, 000 PRIME SEC/FIN 3, 3750% 01/06/27 144A 2, 225, 449 0, 13 USD 2, 250, 000 CRESTWOOD MID 7, 3750% 01/06/25 144A 2, 225, 449 0, 13 USD 2, 250, 000 PRIME SEC/FIN 3, 3750% 01/06/27 144A 2, 225, 449 0, 13 USD 2, 250, 000 PRIME SEC/FIN 3, 3750% 01/06/27 144A 2, 225, 449 0, 13 USD 2, 250, 000 PRIME SEC/FIN 3, 3750% 01/06/27 144A 2, 225, 449 0, 13 USD 2, 250, 000 PRIME SEC/FIN 3, 3750% 01/06/27 144A 2, 225, 449 0, 13 USD 2, 250, 000 CRESTWOOD MID 7, 3750% 01/06/27 144A 2, 225, 449 0, 13 USD 2, 275, 000 SOUTHWESTERN EN 5, 3750% 01/06/27 144A 2, 203, 727 0, 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7, 3750% 01/06/27 WI 2, 208, 755 0, 13 USD 2, 200, 000 CLEVELAND-CUIFF 5, 8750% 01/06/27 WI 2, 199, 013 0, 13 USD 2, 2					
USD 2, 232, 250 VERICAST COR 11, 0000% 15/09/26 144A 2, 371, 766 0.14 USD 2, 450, 000 FRONTIER COMM 5, 8750% 15/10/27 144A 2, 369, 153 0.14 USD 2, 500, 000 SBA COMMUNICATIO 3, 8750% 15/02/27 2, 368, 307 0.14 USD 2, 350, 000 NUSTAR LOGISTICS 6, 3750% 01/10/30 2, 363, 487 0.14 USD 2, 463, 000 NEW ENTERPRIS 5, 2500% 15/07/28 144A 2, 362, 753 0.14 USD 2, 463, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 01/06/29 2, 358, 873 0.14 USD 2, 575, 000 FRONTAIN 4, 5000% 15/06/29 144A 2, 356, 786 0.14 USD 2, 575, 000 FRONTAIN 4, 5000% 15/05/29 144A 2, 334, 919 0.14 USD 2, 600, 000 IRON MOUNTAIN 4, 5000% 15/05/29 144A 2, 334, 919 0.14 USD 2, 200, 000 AMERICAN AIRL 8, 5000% 15/05/29 144A 2, 334, 919 0.14 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 6, 0000% 01/02/29 144A 2, 318, 124 0.14 USD 2, 550, 000 OUTFRONT MEDI 4, 6250% 15/03/30 144A 2, 279, 617 0.14 USD 2, 250, 000 SIZZLING PLAT 8, 5000% 28/11/25 144A 2, 269, 053 0.14 USD 2, 250, 000 SIZZLING PLAT 8, 5000% 28/11/25 144A 2, 269, 053 0.14 USD 2, 250, 000 GRAY TELE INC 7, 0000% 15/05/27 144A 2, 264, 664 0.13 USD 2, 250, 000 THOR INDUSTRI 4, 0000% 15/05/27 144A 2, 253, 213 0.13 USD 2, 250, 000 THOR INDUSTRI 4, 0000% 15/05/27 144A 2, 254, 264, 664 0.13 USD 2, 250, 000 FRIME SEC/FIN 3, 3750% 01/06/25 144A 2, 226, 154 0.13 USD 2, 250, 000 FRIME SEC/FIN 3, 3750% 01/06/25 144A 2, 226, 154 0.13 USD 2, 250, 000 FRIME SEC/FIN 3, 3750% 01/06/25 144A 2, 226, 154 0.13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 5, 7500% 15/01/30 144A 2, 225, 449 0.13 USD 2, 200, 000 VENTURE GLOBA 6, 2500% 15/01/30 144A 2, 225, 162 0.13 USD 2, 200, 000 VENTURE GLOBA 6, 2500% 15/01/30 144A 2, 219, 864 0.13 USD 2, 200, 000 VENTURE GLOBA 6, 2500% 15/01/30 144A 2, 203, 727 0.13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11, 7500% 01/06/27 WI 2, 208, 491 0.13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11, 7500% 01/06/27 WI 2, 208, 491 0.13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11, 7500% 01/06/27 WI 2, 208, 491 0.13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11, 7500% 01/06/27 WI 2, 208, 491 0.13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11, 7500% 01/06/27 WI 2, 208, 727 0.13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11, 7500% 01/					0. 14
USD 2, 450, 000 FRONTIER COMM 5, 8750% 15/10/27 144A 2, 369, 153 0, 14 USD 2, 500, 000 SBA COMMUNICATIO 3, 8750% 15/02/27 2, 368, 307 0, 14 USD 2, 500, 000 NUSTAR LOGISTICS 6, 3750% 01/10/30 2, 363, 487 0, 14 USD 2, 463, 000 NEW ENTERPRIS 5, 2500% 15/07/28 144A 2, 362, 753 0, 14 USD 2, 425, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 01/08/29 144A 2, 356, 786 0, 14 USD 2, 575, 000 PERFORMANCE F 4, 2500% 01/08/29 144A 2, 356, 786 0, 14 USD 2, 500, 000 IRON MOUNTAIN 4, 5000% 15/02/31 144A 2, 334, 919 0, 14 USD 2, 200, 000 AMERICAN AIRL 8, 5000% 15/05/29 144A 2, 334, 919 0, 14 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 6, 0000% 01/02/29 144A 2, 318, 124 0, 14 USD 2, 300, 000 CRESTWOOD MID 6, 0000% 01/02/29 144A 2, 318, 124 0, 14 USD 2, 550, 000 OUTFRONT MEDI 4, 6250% 15/03/30 144A 2, 279, 617 0, 14 USD 2, 250, 000 SIZZLING PLAT 8, 5000% 28/11/25 144A 2, 269, 953 0, 14 USD 2, 250, 000 GRAY TELE INC 7, 0000% 15/05/27 144A 2, 264, 664 0, 13 USD 2, 425, 000 GRAY TELE INC 7, 0000% 15/05/27 144A 2, 246, 894 0, 13 USD 2, 250, 000 THOR INDUSTRI 4, 0000% 15/10/29 144A 2, 246, 894 0, 13 USD 2, 250, 000 THOR INDUSTRI 4, 0000% 15/10/29 144A 2, 228, 900 0, 13 USD 2, 425, 000 FRIME SEC/FIN 3, 3750% 01/02/31 144A 2, 226, 154 0, 13 USD 2, 425, 000 CRESTWOOD MID 7, 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0, 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7, 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0, 13 USD 2, 200, 000 FRIME SEC/FIN 3, 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0, 13 USD 2, 200, 000 VENTURE GLOBA 6, 2500% 15/01/30 144A 2, 210, 127 0, 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7, 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0, 13 USD 2, 200, 000 VENTURE GLOBA 6, 2500% 15/01/30 144A 2, 200, 8491 0, 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7, 3750% 01/02/29 WI 2, 208, 491 0, 13 USD 2, 200, 000 CRECHAIND-CLIFF 5, 8750% 01/06/27 WI 2, 199, 013 0, 13 USD 2, 200, 000 CRECHAIND-CLIFF 5, 8750% 01/06/27 WI 2, 199, 013 0, 13 USD 2, 200, 000 CREVELAND-CLIFF 5, 8750% 01/06/27 WI 2, 199, 013 0, 13 USD 2, 200, 000 CLEVELAND-CLIFF 5, 8750% 01/06/27 WI 2, 199, 013 0, 13 USD 2, 215, 000 CRECHAIND-CLIFF 5, 8750% 01/06/27 WI 2, 199, 013	USD	2, 475, 000	CALPINE CORP 5. 1250% 15/03/28 144A	2, 376, 040	0. 14
USD 2,500,000 SBA COMMUNICATIO 3,8750% 15/02/27 2,368,307 0.14 USD 2,463,000 NUSTAR LOGISTICS 6.3750% 01/10/30 2,363,487 0.14 USD 2,463,000 NEW ENTERPRIS 5.2500% 15/07/28 144A 2,362,753 0.14 USD 2,425,000 SERVICE CORP 5.1250% 01/06/29 2,358,773 0.14 USD 2,575,000 PERFORMANCE F 4.2500% 01/08/29 144A 2,356,786 0.14 USD 2,575,000 PERFORMANCE F 4.2500% 01/08/29 144A 2,334,919 0.14 USD 2,200,000 IRON MOUNTAIN 4.5000% 15/02/31 144A 2,334,919 0.14 USD 2,200,000 CRESTWOOD MID 6.0000% 01/02/29 144A 2,320,556 0.14 USD 2,300,000 CRESTWOOD MID 6.0000% 01/02/29 144A 2,318,124 0.14 USD 2,550,000 OUTFRONT MEDI 4.6250% 15/03/30 144A 2,279,617 0.14 USD 2,250,000 SIZZLING PLAT 8.5000% 28/11/25 144A 2,269,053 0.14 USD 2,250,000 ADT CORP 4.8750% 15/07/32 144A 2,269,053 0.14 USD 2,250,000 MID HOLDINGS 7.3750% 01/06/25 144A 2,264,664 0.13 USD 2,255,000 GRAY TELE INC 7.0000% 15/05/27 144A 2,264,664 0.13 USD 2,255,000 THOR INDUSTRI 4.0000% 15/05/29 144A 2,226,4664 0.13 USD 2,255,000 THOR INDUSTRI 4.0000% 15/05/29 144A 2,226,4664 0.13 USD 2,255,000 THOR INDUSTRI 4.0000% 15/05/29 144A 2,226,4664 0.13 USD 2,255,000 THOR INDUSTRI 4.0000% 15/05/29 144A 2,226,4694 0.13 USD 2,255,000 CRESTWOOD MID 7.3750% 01/06/25 144A 2,226,464 0.13 USD 2,255,000 THOR INDUSTRI 4.0000% 15/05/29 144A 2,226,464 0.13 USD 2,255,000 FRIME SEC/FIN 3.3750% 01/06/25 144A 2,226,464 0.13 USD 2,255,000 PRIME SEC/FIN 3.3750% 01/06/25 144A 2,226,4694 0.13 USD 2,255,000 PRIME SEC/FIN 3.3750% 01/02/29 144A 2,225,469 0.13 USD 2,255,000 SEALED AIR/US 7.2500% 15/01/30 144A 2,225,469 0.13 USD 2,200,000 VENTURE GLOBA 6.2500% 15/01/30 144A 2,210,127 0.13 USD 2,200,000 VENTURE GLOBA 6.2500% 15/01/30 144A 2,200,491 0.13 USD 2,250,000 SEALED AIR/US 7.2500% 15/02/31 144A 2,200,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,200,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.75000% 31/01/29 144A 2,200,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.75000% 31/01/29 144A 2,200,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.75000% 31/01/29 144A 2,200,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.75000% 31	USD	2, 232, 250			0. 14
USD 2, 350, 000 NUSTAR LOGISTICS 6, 3750% 01/10/30 2, 363, 487 0. 14 USD 2, 463, 000 NEW ENTERPRIS 5. 2500% 15/07/28 144A 2, 362, 753 0. 14 USD 2, 425, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 01/06/29 2, 358, 773 0. 14 USD 2, 575, 000 PERFORMANCE F 4. 2500% 01/08/29 144A 2, 356, 786 0. 14 USD 2, 600, 000 IRON MOUNTAIN 4. 5000% 15/02/31 144A 2, 334, 919 0. 14 USD 2, 200, 000 AMERICAN AIRL 8. 5000% 15/05/29 144A 2, 320, 556 0. 14 USD 2, 300, 000 CRESTWOOD MID 6. 0000% 01/02/29 144A 2, 318, 124 0. 14 USD 2, 550, 000 OUTFRONT MEDI 4. 6250% 15/03/30 144A 2, 279, 617 0. 14 USD 2, 250, 000 SIZZLING PLAT 8. 5000% 28/11/25 144A 2, 269, 053 0. 14 USD 2, 500, 000 GRAY TELE INC 7. 0000% 15/05/27 144A 2, 269, 053 0. 14 USD 2, 250, 000 MI HOLDINGS 7. 3750% 01/06/25 144A 2, 264, 664 0. 13 USD 2, 225, 000 NMI HOLDINGS 7. 3750% 01/06/25 144A 2, 246, 894 0. 13 USD 2, 250, 000 THOR INDUSTRI 4. 0000% 15/10/29 144A 2, 228, 900 0. 13 USD 2, 425, 000 PRIME SEC/FIN 3. 3750% 01/06/25 144A 2, 226, 154 0. 13 USD 2, 245, 000 CRSTWOOD MID 7. 3750% 01/06/25 144A 2, 226, 154 0. 13 USD 2, 245, 000 PRIME SEC/FIN 3. 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0. 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7. 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0. 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7. 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0. 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7. 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0. 13 USD 2, 200, 000 SEALED AIR/US 7. 2500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 275, 000 SOUTHWESTERN EN 5. 3750% 01/02/29 WI 2, 208, 755 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13	USD	2, 450, 000	FRONTIER COMM 5.8750% 15/10/27 144A	2, 369, 153	0. 14
USD 2, 350, 000 NUSTAR LOGISTICS 6, 3750% 01/10/30 2, 363, 487 0. 14 USD 2, 463, 000 NEW ENTERPRIS 5. 2500% 15/07/28 144A 2, 362, 753 0. 14 USD 2, 425, 000 SERVICE CORP 5, 1250% 01/06/29 2, 358, 773 0. 14 USD 2, 575, 000 PERFORMANCE F 4. 2500% 01/08/29 144A 2, 356, 786 0. 14 USD 2, 600, 000 IRON MOUNTAIN 4. 5000% 15/02/31 144A 2, 334, 919 0. 14 USD 2, 200, 000 AMERICAN AIRL 8. 5000% 15/05/29 144A 2, 320, 556 0. 14 USD 2, 300, 000 CRESTWOOD MID 6. 0000% 01/02/29 144A 2, 318, 124 0. 14 USD 2, 550, 000 OUTFRONT MEDI 4. 6250% 15/03/30 144A 2, 279, 617 0. 14 USD 2, 250, 000 SIZZLING PLAT 8. 5000% 28/11/25 144A 2, 269, 053 0. 14 USD 2, 500, 000 GRAY TELE INC 7. 0000% 15/05/27 144A 2, 269, 053 0. 14 USD 2, 250, 000 MI HOLDINGS 7. 3750% 01/06/25 144A 2, 264, 664 0. 13 USD 2, 225, 000 NMI HOLDINGS 7. 3750% 01/06/25 144A 2, 246, 894 0. 13 USD 2, 250, 000 THOR INDUSTRI 4. 0000% 15/10/29 144A 2, 228, 900 0. 13 USD 2, 425, 000 PRIME SEC/FIN 3. 3750% 01/06/25 144A 2, 226, 154 0. 13 USD 2, 245, 000 CRSTWOOD MID 7. 3750% 01/06/25 144A 2, 226, 154 0. 13 USD 2, 245, 000 PRIME SEC/FIN 3. 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0. 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7. 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0. 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7. 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0. 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7. 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0. 13 USD 2, 200, 000 SEALED AIR/US 7. 2500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 275, 000 SOUTHWESTERN EN 5. 3750% 01/02/29 WI 2, 208, 755 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13	USD	2, 500, 000	SBA COMMUNICATIO 3.8750% 15/02/27	2, 368, 307	0. 14
USD 2, 425, 000 SERVICE CORP 5. 1250% 01/06/29 2, 358, 773 0. 14 USD 2, 575, 000 PERFORMANCE F 4. 2500% 01/08/29 144A 2, 356, 786 0. 14 USD 2, 600, 000 IRON MOUNTAIN 4. 5000% 15/02/31 144A 2, 334, 919 0. 14 USD 2, 200, 000 AMERICAN AIRL 8. 5000% 15/05/29 144A 2, 320, 556 0. 14 USD 2, 300, 000 CRESTWOOD MID 6. 0000% 01/02/29 144A 2, 318, 124 0. 14 USD 2, 550, 000 OUTFRONT MEDI 4. 6250% 15/03/30 144A 2, 279, 617 0. 14 USD 2, 550, 000 SIZZLING PLAT 8. 5000% 28/11/25 144A 2, 269, 053 0. 14 USD 2, 550, 000 ADT CORP 4. 8750% 15/07/32 144A 2, 269, 053 0. 14 USD 2, 550, 000 GRAY TELE INC 7. 0000% 15/05/27 144A 2, 269, 053 0. 14 USD 2, 250, 000 MIN HOLDINGS 7. 3750% 01/06/25 144A 2, 246, 894 0. 13 USD 2, 250, 000 NMI HOLDINGS 7. 3750% 01/06/25 144A 2, 246, 894 0. 13 USD 2, 500, 000 THOR INDUSTRI 4. 0000% 15/10/29 144A 2, 228, 900 0. 13 USD 4, 200, 000 CSC HOLDINGS 5. 7500% 15/01/30 144A 2, 226, 154 0. 13 USD 2, 425, 000 PRIME SEC/FIN 3. 3750% 31/08/27 144A 2, 225, 449 0. 13 USD 2, 425, 000 PRIME SEC/FIN 3. 3750% 31/08/27 144A 2, 225, 449 0. 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7. 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0. 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7. 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0. 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7. 3750% 01/02/31 144A 2, 219, 864 0. 13 USD 2, 200, 000 VENTURE GLOBA 6. 2500% 15/01/30 144A 2, 219, 864 0. 13 USD 2, 200, 000 SEALED AIR/US 7. 2500% 15/01/30 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 275, 000 SOUTHWESTERN EN 5. 3750% 01/02/29 WI 2, 208, 755 0. 13 USD 2, 200, 000 CEVELAND-CLIFF 5. 8750% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CLEVELAND-CLIFF 5. 8750% 01/06/27 WI 2, 208, 727 0. 13 USD 2, 200, 000 CLEVELAND-CLIFF 5. 8750% 01/06/27 WI 2, 199, 013 0. 13 USD 2, 412, 000 ZIFF DAVIS IN 4. 6250% 15/10/30 144A 2, 184, 766 0. 13	USD	2, 350, 000	NUSTAR LOGISTICS 6.3750% 01/10/30		0.14
USD 2, 425, 000 SERVICE CORP 5. 1250% 01/06/29 2, 358, 773 0. 14 USD 2, 575, 000 PERFORMANCE F 4. 2500% 01/08/29 144A 2, 356, 786 0. 14 USD 2, 600, 000 IRON MOUNTAIN 4. 5000% 15/08/29 144A 2, 334, 919 0. 14 USD 2, 200, 000 AMERICAN AIRL 8. 5000% 15/05/29 144A 2, 334, 919 0. 14 USD 2, 300, 000 CRESTWOOD MID 6. 0000% 01/02/29 144A 2, 318, 124 0. 14 USD 2, 550, 000 OUTFRONT MEDI 4. 6250% 15/03/30 144A 2, 279, 617 0. 14 USD 2, 550, 000 SIZZLING PLAT 8. 5000% 28/11/25 144A 2, 269, 053 0. 14 USD 2, 550, 000 ADT CORP 4. 8750% 15/07/32 144A 2, 269, 053 0. 14 USD 2, 250, 000 ADT CORP 4. 8750% 15/07/32 144A 2, 264, 664 0. 13 USD 2, 425, 000 GRAY TELE INC 7. 0000% 15/05/27 144A 2, 253, 213 0. 13 USD 2, 250, 000 NMI HOLDINGS 7. 3750% 01/06/25 144A 2, 246, 894 0. 13 USD 2, 500, 000 THOR INDUSTRI 4. 0000% 15/10/29 144A 2, 228, 900 0. 13 USD 4, 200, 000 CSC HOLDINGS 5. 7500% 15/01/30 144A 2, 226, 154 0. 13 USD 2, 425, 000 PRIME SEC/FIN 3. 3750% 31/08/27 144A 2, 225, 449 0. 13 USD 2, 425, 000 CRESTWOOD MID 7. 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 449 0. 13 USD 2, 200, 000 CRESTWOOD MID 7. 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0. 13 USD 2, 200, 000 VENTURE GLOBA 6. 2500% 15/01/30 144A 2, 219, 864 0. 13 USD 2, 275, 000 SOUTHWESTERN EN 5. 3750% 01/02/29 WI 2, 208, 755 0. 13 USD 2, 275, 000 SEALED AIR/US 7. 2500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 15. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 15. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CEVELAND-CLIFF 5. 8750% 01/06/27 WI 2, 208, 727 0. 13 USD 2, 200, 000 CLEVELAND-CLIFF 5. 8750% 01/06/27 WI 2, 199, 013 0. 13 USD 2, 412, 000 ZIFF DAVIS IN 4. 6250% 15/10/30 144A 2, 184, 766 0. 13	USD	2, 463, 000	NEW ENTERPRIS 5. 2500% 15/07/28 144A	2, 362, 753	0.14
USD 2,575,000 PERFORMANCE F 4.2500% 01/08/29 144A 2,356,786 0.14 USD 2,600,000 IRON MOUNTAIN 4.5000% 15/05/29 144A 2,334,919 0.14 USD 2,200,000 AMERICAN AIRL 8.5000% 15/05/29 144A 2,320,556 0.14 USD 2,300,000 CRESTWOOD MID 6.0000% 01/02/29 144A 2,318,124 0.14 USD 2,550,000 OUTFRONT MEDI 4.6250% 15/03/30 144A 2,279,617 0.14 USD 2,250,000 SIZZLING PLAT 8.5000% 28/11/25 144A 2,269,053 0.14 USD 2,250,000 ADT CORP 4.8750% 15/07/32 144A 2,269,053 0.14 USD 2,250,000 GRAY TELE INC 7.0000% 15/05/27 144A 2,264,664 0.13 USD 2,250,000 NMI HOLDINGS 7.3750% 01/06/25 144A 2,264,894 0.13 USD 2,250,000 NMI HOLDINGS 7.3750% 01/06/25 144A 2,226,894 0.13 USD 2,250,000 THOR INDUSTRI 4.0000% 15/10/29 144A 2,228,900 0.13 USD 2,425,000 PRIME SEC/FIN 3.3750% 31/08/27 144A 2,225,449 0.13 USD 2,425,000 PRIME SEC/FIN 3.3750% 01/06/25 144A 2,225,449 0.13 USD 2,250,000 CRESTWOOD MID 7.3750% 01/06/23 144A 2,225,449 0.13 USD 2,200,000 CRESTWOOD MID 7.3750% 01/06/23 144A 2,225,162 0.13 USD 2,200,000 ALLIED UNIVER 7.8750% 15/02/31 144A 2,225,162 0.13 USD 2,200,000 ALLIED UNIVER 7.8750% 15/02/31 144A 2,219,864 0.13 USD 2,200,000 SEALED AIR/US 7.2500% 15/01/30 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 WI 2,208,755 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 15/0	USD	2, 425, 000		2, 358, 773	0.14
USD 2,600,000 IRON MOUNTAIN 4.5000% 15/02/31 144A 2,334,919 0.14 USD 2,200,000 AMERICAN AIRL 8.5000% 15/05/29 144A 2,320,556 0.14 USD 2,300,000 CRESTWOOD MID 6.0000% 01/02/29 144A 2,318,124 0.14 USD 2,550,000 OUTFRONT MEDI 4.6250% 15/03/30 144A 2,279,617 0.14 USD 2,250,000 SIZZLING PLAT 8.5000% 28/11/25 144A 2,269,053 0.14 USD 2,500,000 ADT CORP 4.8750% 15/07/32 144A 2,269,053 0.14 USD 2,250,000 MIT HOLDINGS 7.3750% 01/06/25 144A 2,264,664 0.13 USD 2,250,000 MIT HOLDINGS 7.3750% 01/06/25 144A 2,246,894 0.13 USD 2,250,000 THOR INDUSTRI 4.0000% 15/10/29 144A 2,228,900 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 5.7500% 15/01/30 144A 2,226,154 0.13 USD 2,250,000 PRIME SEC/FIN 3.3750% 31/08/27 144A 2,225,162 0.13 USD 2,125,000 CRESTWOOD MID 7.3750% 01/02/31 144A 2,225,162 0.13 USD 2,200,000 CRESTWOOD MID 7.3750% 01/02/31 144A 2,225,162 0.13 USD 2,200,000 ALLIED UNIVER 7.8750% 15/01/30 144A 2,219,864 0.13 USD 2,200,000 SEALED AIR/US 7.3750% 01/02/29 WI 2,208,755 0.13 USD 2,200,000 SEALED AIR/US 7.2500% 15/01/30 144A 2,210,127 0.13 USD 2,200,000 SEALED AIR/US 7.2500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01	USD			2, 356, 786	0.14
USD 2, 200, 000 AMERICAN AIRL 8, 5000% 15/05/29 144A 2, 320, 556 0. 14 USD 2, 300, 000 CRESTWOOD MID 6, 0000% 01/02/29 144A 2, 318, 124 0. 14 USD 2, 550, 000 OUTFRONT MEDI 4, 6250% 15/03/30 144A 2, 219, 617 0. 14 USD 2, 250, 000 SIZZLING PLAT 8, 5000% 28/11/25 144A 2, 269, 053 0. 14 USD 2, 500, 000 ADT CORP 4, 8750% 15/07/32 144A 2, 264, 664 0. 13 USD 2, 425, 000 GRAY TELE INC 7, 0000% 15/05/27 144A 2, 253, 213 0. 13 USD 2, 225, 000 NMI HOLDINGS 7, 3750% 01/06/25 144A 2, 246, 894 0. 13 USD 2, 500, 000 THOR INDUSTRI 4, 0000% 15/10/29 144A 2, 228, 900 0. 13 USD 4, 200, 000 CSC HOLDINGS 5, 7500% 15/01/30 144A 2, 226, 154 0. 13 USD 2, 425, 000 PRIME SEC/FIN 3, 3750% 31/08/27 144A 2, 225, 449 0. 13 USD 2, 125, 000 CRESTWOOD MID 7, 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0. 13 USD 2, 200, 000 ALLIED UNIVER 7, 8750% 15/02/31 144A 2, 219, 864 0. 13 USD 2, 200, 000 VENTURE GLOBA 6, 2500% 15/01/30 144A 2, 210, 127 0. 13 USD 2, 275, 000 SOUTHWESTERN EN 5, 3750% 01/02/29 WI 2, 208, 755 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 01/02/29 WI 2, 208, 755 0. 13 USD 2, 200, 000 SEALED AIR/US 7, 2500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 203, 727 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 208, 491 0. 13					
USD 2,300,000 CRESTWOOD MID 6.0000% 01/02/29 144A 2,318,124 0.14 USD 2,550,000 OUTFRONT MEDI 4.6250% 15/03/30 144A 2,279,617 0.14 USD 2,250,000 SIZZLING PLAT 8.5000% 28/11/25 144A 2,269,053 0.14 USD 2,500,000 ADT CORP 4.8750% 15/07/32 144A 2,264,664 0.13 USD 2,425,000 GRAY TELE INC 7.0000% 15/05/27 144A 2,253,213 0.13 USD 2,255,000 NMI HOLDINGS 7.3750% 01/06/25 144A 2,246,894 0.13 USD 2,250,000 THOR INDUSTRI 4.0000% 15/10/29 144A 2,228,900 0.13 USD 4,200,000 CSC HOLDINGS 5.7500% 15/01/30 144A 2,226,154 0.13 USD 2,425,000 PRIME SEC/FIN 3.3750% 01/06/25 144A 2,225,425,000 0.13 USD 4,200,000 CSC HOLDINGS 5.7500% 15/01/30 144A 2,225,162 0.13 USD 2,425,000 CRESTWOOD MID 7.3750% 01/02/31 144A 2,225,162 0.13 USD 2,200,000 CRESTWOOD MID 7.3750% 01/02/31 144A 2,225,162 0.13 USD 2,200,000 VENTURE GLOBA 6.2500% 15/01/30 144A 2,219,864 0.13 USD 2,275,000 SOUTHWESTERN EN 5.3750% 01/02/29 WI 2,208,755 0.13 USD 2,275,000 SOUTHWESTERN EN 5.3750% 01/02/29 WI 2,208,755 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 1.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 1.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 1.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 1.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 1.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 1.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 1.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 1.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 1.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 1.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 1.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 1.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 1.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 1.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 1.7500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,412,000 ZIFF DAVIS IN 4.6250% 15/10/30 144A 2,184,766 0.13					
USD 2,550,000 OUTFRONT MEDI 4.6250% 15/03/30 144A 2,279,617 0.14 USD 2,250,000 SIZZLING PLAT 8.5000% 28/11/25 144A 2,269,053 0.14 USD 2,500,000 ADT CORP 4.8750% 15/07/32 144A 2,264,664 0.13 USD 2,425,000 GRAY TELE INC 7.0000% 15/05/27 144A 2,264,664 0.13 USD 2,250,000 NMI HOLDINGS 7.3750% 01/06/25 144A 2,246,894 0.13 USD 2,250,000 THOR INDUSTRI 4.0000% 15/10/29 144A 2,228,900 0.13 USD 4,200,000 CSC HOLDINGS 5.7500% 15/01/30 144A 2,226,154 0.13 USD 2,425,000 PRIME SEC/FIN 3.3750% 31/08/27 144A 2,225,449 0.13 USD 2,425,000 CRESTWOOD MID 7.3750% 01/02/31 144A 2,225,162 0.13 USD 2,200,000 CRESTWOOD MID 7.3750% 01/02/31 144A 2,225,162 0.13 USD 2,200,000 ALLIED UNIVER 7.8750% 15/02/31 144A 2,219,864 0.13 USD 2,200,000 VENTURE GLOBA 6.2500% 15/01/30 144A 2,210,127 0.13 USD 2,275,000 SOUTHWESTERN EN 5.3750% 01/02/29 WI 2,208,755 0.13 USD 2,25,000 SEALED AIR/US 7.2500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CCC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CCC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,412,000 ZIFF DAVIS IN 4.6250% 15/					
USD 2, 250, 000 SIZZLING PLAT 8, 5000% 28/11/25 144A 2, 269, 053 0. 14 USD 2, 500, 000 ADT CORP 4, 8750% 15/07/32 144A 2, 264, 664 0. 13 USD 2, 425, 000 GRAY TELE INC 7. 0000% 15/05/27 144A 2, 253, 213 0. 13 USD 2, 225, 000 NMI HOLDINGS 7. 3750% 01/06/25 144A 2, 246, 894 0. 13 USD 2, 500, 000 THOR INDUSTRI 4. 0000% 15/10/29 144A 2, 228, 900 0. 13 USD 4, 200, 000 CSC HOLDINGS 5. 7500% 15/01/30 144A 2, 226, 154 0. 13 USD 2, 425, 000 PRIME SEC/FIN 3. 3750% 31/08/27 144A 2, 225, 449 0. 13 USD 2, 125, 000 CRESTWOOD MID 7. 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0. 13 USD 2, 200, 000 ALLIED UNIVER 7. 8750% 15/02/31 144A 2, 219, 864 0. 13 USD 2, 200, 000 VENTURE GLOBA 6. 2500% 15/01/30 144A 2, 210, 127 0. 13 USD 2, 275, 000 SOUTHWESTERN EN 5. 3750% 01/02/29 WI 2, 208, 755 0. 13 USD 2, 125, 000 SEALED AIR/US 7. 2500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 203, 727 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 01/06/27 WI 2, 199, 013 0. 13 USD 2, 412, 000 ZIFF DAVIS IN 4. 6250% 15/10/30 144A 2, 184, 766 0. 13					
USD 2,500,000 ADT CORP 4.8750% 15/07/32 144A 2,264,664 0.13 USD 2,425,000 GRAY TELE INC 7.0000% 15/05/27 144A 2,253,213 0.13 USD 2,255,000 NMI HOLDINGS 7.3750% 01/06/25 144A 2,246,894 0.13 USD 2,500,000 THOR INDUSTRI 4.0000% 15/10/29 144A 2,228,900 0.13 USD 4,200,000 CSC HOLDINGS 5.7500% 15/01/30 144A 2,226,154 0.13 USD 2,425,000 PRIME SEC/FIN 3.3750% 31/08/27 144A 2,225,449 0.13 USD 2,125,000 CRESTWOOD MID 7.3750% 01/02/31 144A 2,225,162 0.13 USD 2,200,000 ALIED UNIVER 7.8750% 01/02/31 144A 2,219,864 0.13 USD 2,200,000 VENTURE GLOBA 6.2500% 15/01/30 144A 2,219,864 0.13 USD 2,275,000 SOUTHWESTERN EN 5.3750% 01/02/29 WI 2,208,755 0.13 USD 2,275,000 SOUTHWESTERN EN 5.3750% 01/02/29 WI 2,208,755 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,727 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,208,727 0.13 USD 2,200,000 CLEVELAND-CLIFF 5.8750% 01/06/27 WI 2,199,013 0.13 USD 2,412,000 ZIFF DAVIS IN 4.6250% 15/10/30 144A 2,184,766 0.13					
USD 2, 425, 000 GRAY TELE INC 7. 0000% 15/05/27 144A 2, 253, 213 0. 13 USD 2, 225, 000 NMI HOLDINGS 7. 3750% 01/06/25 144A 2, 246, 894 0. 13 USD 2, 500, 000 THOR INDUSTRI 4. 0000% 15/10/29 144A 2, 228, 900 0. 13 USD 4, 200, 000 CSC HOLDINGS 5. 7500% 15/01/30 144A 2, 226, 154 0. 13 USD 2, 425, 000 PRIME SEC/FIN 3. 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 449 0. 13 USD 2, 125, 000 CRESTWOOD MID 7. 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0. 13 USD 2, 200, 000 ALLIED UNIVER 7. 8750% 15/02/31 144A 2, 219, 864 0. 13 USD 2, 200, 000 VENTURE GLOBA 6. 2500% 15/01/30 144A 2, 219, 864 0. 13 USD 2, 275, 000 SOUTHWESTERN EN 5. 3750% 01/02/29 WI 2, 208, 755 0. 13 USD 2, 125, 000 SEALED AIR/US 7. 2500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CLEVELAND-CLIFF 5. 8750% 01/06/27 WI 2, 199, 013 0. 13 USD 2, 412, 000 ZIFF DAVIS IN 4. 6250% 15/10/30 144A 2, 184, 766 0. 13					
USD 2, 225, 000 NMI HOLDINGS 7. 3750% 01/06/25 144A 2, 246, 894 0. 13 USD 2, 500, 000 THOR INDUSTRI 4. 0000% 15/10/29 144A 2, 228, 900 0. 13 USD 4, 200, 000 CSC HOLDINGS 5. 7500% 15/01/30 144A 2, 226, 154 0. 13 USD 2, 425, 000 PRIME SEC/FIN 3. 3750% 31/08/27 144A 2, 225, 162 0. 13 USD 2, 125, 000 CRESTWOOD MID 7. 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0. 13 USD 2, 200, 000 ALLIED UNIVER 7. 8750% 15/02/31 144A 2, 219, 864 0. 13 USD 2, 200, 000 VENTURE GLOBA 6. 2500% 15/01/30 144A 2, 210, 127 0. 13 USD 2, 275, 000 SOUTHWESTERN EN 5. 3750% 01/02/29 WI 2, 208, 755 0. 13 USD 2, 125, 000 SEALED AIR/US 7. 2500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 203, 727 0. 13 USD 2, 200, 000 CLEVELAND-CLIFF 5. 8750% 01/06/27 WI 2, 199, 013 0. 13 USD 2, 412, 000 ZIFF DAVIS IN 4. 6250% 15/10/30 144A 2, 184, 766 0. 13			CRAV TELE INC 7 0000% 15/05/27 1444		
USD 2,500,000 THOR INDUSTRI 4.0000% 15/10/29 144A 2,228,900 0.13 USD 4,200,000 CSC HOLDINGS 5.7500% 15/01/30 144A 2,226,154 0.13 USD 2,425,000 PRIME SEC/FIN 3.3750% 31/08/27 144A 2,225,449 0.13 USD 2,125,000 CRESTWOOD MID 7.3750% 01/02/31 144A 2,225,162 0.13 USD 2,200,000 ALLIED UNIVER 7.8750% 15/02/31 144A 2,219,864 0.13 USD 2,200,000 VENTURE GLOBA 6.2500% 15/01/30 144A 2,210,127 0.13 USD 2,275,000 SOUTHWESTERN EN 5.3750% 01/02/29 WI 2,208,755 0.13 USD 2,125,000 SEALED AIR/US 7.2500% 15/02/31 144A 2,208,491 0.13 USD 2,200,000 CSC HOLDINGS 11.7500% 31/01/29 144A 2,203,727 0.13 USD 2,200,000 CLEVELAND-CLIFF 5.8750% 01/02/29 WI 2,199,013 0.13 USD 2,412,000 ZIFF DAVIS IN 4.6250% 15/10/30 144A 2,184,766 0.13			NMI HOLDINGS 7 27509/- 01/06/25 1444		
USD 4, 200, 000 CSC HOLDINGS 5. 7500% 15/01/30 144A 2, 226, 154 0. 13 USD 2, 425, 000 PRIME SEC/FIN 3. 3750% 31/08/27 144A 2, 225, 449 0. 13 USD 2, 125, 000 CRESTWOOD MID 7. 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0. 13 USD 2, 200, 000 ALLIED UNIVER 7. 8750% 15/02/31 144A 2, 219, 864 0. 13 USD 2, 200, 000 VENTURE GLOBA 6. 2500% 15/01/30 144A 2, 210, 127 0. 13 USD 2, 275, 000 SOUTHWESTERN EN 5. 3750% 01/02/29 WI 2, 208, 755 0. 13 USD 2, 125, 000 SEALED AIR/US 7. 2500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 203, 727 0. 13 USD 2, 200, 000 CLEVELAND-CLIFF 5. 8750% 01/06/27 WI 2, 199, 013 0. 13 USD 2, 412, 000 ZIFF DAVIS IN 4. 6250% 15/10/30 144A 2, 184, 766 0. 13					
USD 2, 425, 000 PRIME SEC/FIN 3. 3750% 31/08/27 144A 2, 225, 449 0. 13 USD 2, 125, 000 CRESTWOOD MID 7. 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0. 13 USD 2, 200, 000 ALLIED UNIVER 7. 8750% 15/02/31 144A 2, 219, 864 0. 13 USD 2, 200, 000 VENTURE GLOBA 6. 2500% 15/01/30 144A 2, 210, 127 0. 13 USD 2, 275, 000 SOUTHWESTERN EN 5. 3750% 01/02/29 WI 2, 208, 755 0. 13 USD 2, 125, 000 SEALED AIR/US 7. 2500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 203, 727 0. 13 USD 2, 200, 000 CLEVELAND-CLIFF 5. 8750% 01/06/27 WI 2, 199, 013 0. 13 USD 2, 412, 000 ZIFF DAVIS IN 4. 6250% 15/10/30 144A 2, 184, 766 0. 13					
USD 2, 125, 000 CRESTWOOD MID 7, 3750% 01/02/31 144A 2, 225, 162 0. 13 USD 2, 200, 000 ALLIED UNIVER 7, 8750% 15/02/31 144A 2, 219, 864 0. 13 USD 2, 200, 000 VENTURE GLOBA 6, 2500% 15/01/30 144A 2, 210, 127 0. 13 USD 2, 275, 000 SOUTHWESTERN EN 5. 3750% 01/02/29 WI 2, 208, 755 0. 13 USD 2, 125, 000 SEALED AIR/US 7, 2500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11, 7500% 31/01/29 144A 2, 203, 727 0. 13 USD 2, 200, 000 CLEVELAND-CLIFF 5, 8750% 01/06/27 WI 2, 199, 013 0. 13 USD 2, 412, 000 ZIFF DAVIS IN 4. 6250% 15/10/30 144A 2, 184, 766 0. 13					
USD 2, 200, 000 ALLIED UNIVER 7. 8750% 15/02/31 144A 2, 219, 864 0. 13 USD 2, 200, 000 VENTURE GLOBA 6. 2500% 15/01/30 144A 2, 210, 127 0. 13 USD 2, 275, 000 SOUTHWESTERN EN 5. 3750% 01/02/29 WI 2, 208, 755 0. 13 USD 2, 125, 000 SEALED AIR/US 7. 2500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CLEVELAND-CLIFF 5. 8750% 01/06/27 WI 2, 199, 013 0. 13 USD 2, 412, 000 ZIFF DAVIS IN 4. 6250% 15/10/30 144A 2, 184, 766 0. 13					
USD 2, 200, 000 VENTURE GLOBA 6. 2500% 15/01/30 144A 2, 210, 127 0. 13 USD 2, 275, 000 SOUTHWESTERN EN 5. 3750% 01/02/29 WI 2, 208, 755 0. 13 USD 2, 125, 000 SEALED AIR/US 7. 2500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 203, 727 0. 13 USD 2, 200, 000 CLEVELAND-CLIFF 5. 8750% 01/06/27 WI 2, 199, 013 0. 13 USD 2, 412, 000 ZIFF DAVIS IN 4. 6250% 15/10/30 144A 2, 184, 766 0. 13					
USD 2, 275, 000 SOUTHWESTERN EN 5. 3750% 01/02/29 WI 2, 208, 755 0. 13 USD 2, 125, 000 SEALED AIR/US 7. 2500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 203, 727 0. 13 USD 2, 200, 000 CLEVELAND-CLIFF 5. 8750% 01/06/27 WI 2, 199, 013 0. 13 USD 2, 412, 000 ZIFF DAVIS IN 4. 6250% 15/10/30 144A 2, 184, 766 0. 13					
USD 2, 125, 000 SEALED AIR/US 7. 2500% 15/02/31 144A 2, 208, 491 0. 13 USD 2, 200, 000 CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A 2, 203, 727 0. 13 USD 2, 200, 000 CLEVELAND-CLIFF 5. 8750% 01/06/27 WI 2, 199, 013 0. 13 USD 2, 412, 000 ZIFF DAVIS IN 4. 6250% 15/10/30 144A 2, 184, 766 0. 13					
USD       2, 200, 000       CSC HOLDINGS 11. 7500% 31/01/29 144A       2, 203, 727       0. 13         USD       2, 200, 000       CLEVELAND-CLIFF 5. 8750% 01/06/27 WI       2, 199, 013       0. 13         USD       2, 412, 000       ZIFF DAVIS IN 4. 6250% 15/10/30 144A       2, 184, 766       0. 13					
USD 2, 200, 000 CLEVELAND-CLIFF 5. 8750% 01/06/27 WI 2, 199, 013 0. 13 USD 2, 412, 000 ZIFF DAVIS IN 4. 6250% 15/10/30 144A 2, 184, 766 0. 13					
USD 2, 412, 000 ZIFF DAVIS IN 4.6250% 15/10/30 144A 2, 184, 766 0.13					
USD 2, 200, 000 NEXTERA ENERG 4. 2500% 15/07/24 144A 2, 180, 109 0. 13					
	USD	2, 200, 000	NEXTERA ENERG 4.2500% 15/07/24 144A	2, 180, 109	0. 13

通貨	数量/額面(1)	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	2, 450, 000	CENTENE CORP 3.3750% 15/02/30 WI	2, 170, 259	0. 13
USD	2, 650, 000	CCO HOLDINGS 4.7500% 01/02/32 144A	2, 162, 536	0.13
USD	2, 250, 000	STANDARD INDS 4.7500% 15/01/28 144A	2, 144, 905	0. 13
USD	2, 575, 000	SIRIUS XM RAD 3. 8750% 01/09/31 144A	2, 144, 616	0. 13
USD	2, 000, 000	NAVIENT CORP 9.3750% 25/07/30	2, 134, 130	0. 13
USD	3, 000, 000	CSC HOLDINGS 4. 5000% 15/11/31 144A	2, 126, 333	0. 13
USD	2, 350, 000	AVANTOR FUNDI 3. 8750% 01/11/29 144A	2, 117, 285	0.13
USD	2, 258, 000	NEXTERA ENERG 4. 5000% 15/09/27 144A	2, 115, 239	0.13
USD	2, 100, 000	WYNDHAM INC 6. 6250% 31/07/26 144A	2, 112, 814	0. 13
USD	2, 100, 000	MURPHY OIL CORP 6. 3750% 15/07/28	2, 111, 976	0. 13
USD	1, 975, 000	HELIX ENERGY 9. 7500% 01/03/29 144A	2, 108, 076	0. 13
USD	2, 100, 000	CARPENTER TECH 6. 3750% 15/07/28	2, 095, 181	0. 12
USD	2, 125, 000	FERRELLGAS LP 5. 3750% 01/04/26 144A	2, 081, 346	0. 12
USD	2, 050, 000	COTY/HFC PRES 6.6250% 15/07/30 144A	2, 078, 595	0. 12
USD	2, 250, 000	VISTRA OPERAT 4.3750% 01/05/29 144A	2, 078, 172	0.12
USD	2, 200, 000	CLEAR CHANNEL 5. 1250% 15/08/27 144A	2, 072, 982	0.12
USD	2, 200, 000	II-VI INC 5.0000% 15/12/29 144A	2, 067, 979	0.12
USD	2, 075, 000	HESS MIDSTREA 5.6250% 15/02/26 144A	2, 056, 094	0.12
USD	1, 925, 000	NRG ENERGY IN 7.0000% 15/03/33 144A	2, 054, 450	0.12
USD	2, 200, 000	ORGANON & CO/ 4.1250% 30/04/28 144A	2, 044, 061	0. 12
USD	1, 975, 000	WYNN RESORTS 7.1250% 15/02/31 144A	2, 041, 990	0. 12
USD	2,075,000	POST HOLDINGS 5.6250% 15/01/28 144A	2, 039, 390	0.12
USD	2, 150, 000	MGM RESORTS 4.7500% 15/10/28	2, 038, 702	0.12
USD	2, 175, 000	NOVELIS CORP 4.7500% 30/01/30 144A	2, 012, 458	0.12
USD	2, 237, 000	LAMB WESTON H 4.3750% 31/01/32 144A	2,008,847	0.12
USD	1, 950, 000	TRINITY IND 7.7500% 15/07/28 144A	1, 991, 843	0. 12
USD	2, 057, 000	IRON MOUNTAIN 5. 2500% 15/03/28 144A	1, 991, 373	0. 12
USD	1, 950, 000	ANTERO MIDSTR 7. 8750% 15/05/26 144A	1, 990, 363	0. 12
USD	2, 025, 000	PERMIAN RESR 5.8750% 01/07/29 144A	1, 989, 333	0. 12
USD	1, 875, 000	ONEMAIN FINANCE 9. 0000% 15/01/29	1, 986, 894	0. 12
USD	2, 075, 000	TARGA RES PRTNRS 4.8750% 01/02/31	1, 984, 569	0. 12
USD	1, 975, 000	CITGO PETROLE 6. 3750% 15/06/26 144A	1, 980, 970	0. 12
USD	2, 125, 000	PARK INTERMED 4. 8750% 15/05/29 144A	1, 978, 248	0. 12
USD	1, 800, 000	FREEDOM MORT 12.2500% 01/10/30 144A	1, 971, 745	0. 12
USD	1,800,000	FREEDOM MORT 12. 2300 % 01/10/30 144A FREEDOM MORT 12. 0000% 01/10/28 144A	1, 960, 522	0. 12
USD	1,800,000	SPIRIT AEROSY 9. 3750% 30/11/29 144A	1, 960, 222	0. 12
USD	2,000,000	UNIVISION COM 6. 6250% 01/06/27 144A	1, 956, 068	0. 12
USD	2, 475, 000	DISH DBS CORP 5. 2500% 01/12/26 144A	1, 954, 446	0. 12
USD	2, 500, 000	CCO HOLDINGS 4.5000% 01/06/33 144A	1, 950, 943	0. 12
USD	2,000,000	PRESTIGE BRAN 5. 1250% 15/01/28 144A	1, 948, 305	0. 12
USD	2, 075, 000	SEALED AIR CO 4.0000% 01/12/27 144A	1, 944, 464	0. 12
USD	2,000,000	UNITED RENTAL NA 4.8750% 15/01/28	1, 943, 094	0. 12
USD	1, 925, 000	LAREDO PETROL 7.7500% 31/07/29 144A	1, 940, 683	0.12
USD	2, 075, 000	SIRIUS XM RAD 3.1250% 01/09/26 144A	1, 939, 652	0.12
USD	1, 975, 000	PARK INTERMED 5.8750% 01/10/28 144A	1, 937, 139	0.12
USD	1, 975, 000	GOODYEAR TIRE 5.0000% 31/05/26	1, 932, 016	0.12
USD	2,000,000	VERTICAL US N 5.2500% 15/07/27 144A	1, 930, 233	0.11
USD	2, 350, 000	ZAYO GROUP HO 4.0000% 01/03/27 144A	1, 924, 127	0.11
USD	1, 950, 000	MACY'S RETAIL 5.8750% 01/04/29 144A	1, 910, 628	0.11
USD	2, 125, 000	CENTURY COMMU 3.8750% 15/08/29 144A	1, 906, 382	0.11
USD	2,000,000	WR GRACE HOLD 4.8750% 15/06/27 144A	1, 900, 552	0.11
USD	2,000,000	OLIN CORP 5.0000% 01/02/30	1, 895, 509	0.11
USD	1,875,000	TRANSDIGM INC 6.3750% 01/03/29 144A	1, 881, 126	0.11
USD	2, 075, 000	COMSTOCK RE I 5. 8750% 15/01/30 144A	1, 880, 176	0. 11
USD	1, 875, 000	VICI PROPERTI 5. 7500% 01/02/27 144A	1, 873, 316	0.11
USD	2, 000, 000	LAMAR MEDIA CORP 3. 7500% 15/02/28	1, 872, 612	0. 11
USD	1, 850, 000	AET UNI/AET F 8. 2500% 15/02/26 144A	1, 871, 865	0. 11
USD	1, 800, 000	FORD MOTOR CRED 6. 8000% 12/05/28	1, 870, 457	0.11
USD	1, 825, 000	PM GENERAL PU 9.5000% 01/10/28 144A	1, 863, 380	0. 11
USD	1, 925, 000	CHENIERE ENERGY 4. 6250% 15/10/28 WI	1, 863, 143	0. 11
USD	2,000,000	SLM CORP 3. 1250% 02/11/26	1, 857, 223	0.11
USD	2, 030, 000	SUNOCO LP/FIN 4.5000% 30/04/30	1, 856, 795	0.11

通貨	数量/額面(1)	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	2,000,000	FRONTIER COMM 5.0000% 01/05/28 144A	1, 853, 625	0. 11
USD	1, 825, 000	ARCHROCK LP/F 6. 8750% 01/04/27 144A	1, 830, 101	0.11
USD	2,000,000	CCO HOLDINGS 5. 3750% 01/06/29 144A	1, 825, 354	0. 11
USD	1, 725, 000	HOWARD MIDSTR 8. 8750% 15/07/28 144A	1, 825, 250	0. 11
USD	1, 800, 000	PANTHER ESCRO 7. 1250% 01/06/31 144A	1, 824, 300	0. 11
USD	1, 900, 000	SEALED AIR CO 5. 0000% 15/04/29 144A	1, 821, 948	0. 11
USD	1,775,000	NEWMARK GROUP 7. 5000% 12/01/29 144A	1, 821, 338	0. 11
USD	1, 775, 000	JEFFERSON CAP 9. 5000% 15/02/29 144A	1, 813, 127	0. 11
USD	1, 700, 000	FORD MOTOR CRED 7. 3500% 06/03/30	1, 812, 174	0. 11
USD	1, 975, 000	TRAVEL + LEIS 4.5000% 01/12/29 144A	1, 810, 641	0. 11
USD	1,875,000	PG&E CORP 5.0000% 01/07/28	1, 806, 255	0. 11
USD	1,850,000	AG ISSUER LLC 6. 2500% 01/03/28 144A	1, 805, 323	0. 11
USD	1, 750, 000	ENLINK MIDSTR 6.5000% 01/09/30 144A	1, 799, 406	0.11
USD	2, 025, 000	WMG ACQUISITI 3.8750% 15/07/30 144A	1, 793, 715	0.11
USD	1, 850, 000	PRESIDIO HLDG 4.8750% 01/02/27 144A	1, 792, 898	0.11
USD	1, 950, 000	FERTITTA ENT 4.6250% 15/01/29 144A	1, 787, 212	0.11
USD	1, 875, 000	PG&E CORP 5.2500% 01/07/30	1, 786, 082	0.11
USD	1, 800, 000	SPECIALTY BUI 6.3750% 30/09/26 144A	1, 785, 987	0.11
USD	1, 700, 000	GREYSTAR REAL 7.7500% 01/09/30 144A	1, 780, 130	0.11
USD	1, 814, 000	CHS/COMMUNITY 8.0000% 15/12/27 144A	1, 778, 526	0.11
USD	1, 975, 000	LITHIA MOTORS 3.8750% 01/06/29 144A	1, 777, 298	0.11
USD	1, 950, 000	TENNECO INC 8.0000% 17/11/28 144A	1, 775, 165	0.11
USD	1, 700, 000	HAT HOLDINGS 8.0000% 15/06/27 144A	1, 771, 453	0.11
USD	1, 775, 000	HOWARD MIDSTR 6. 7500% 15/01/27 144A	1, 769, 578	0.11
USD	1,775,000	HAT HOLDINGS 6.0000% 15/04/25 144A	1, 766, 881	0.11
USD	1, 825, 000	ARDAGH METAL 6.0000% 15/06/27 144A	1, 765, 561	0. 11
USD	1, 825, 000	NEW FORTRESS 6. 5000% 30/09/26 144A	1, 757, 810	0. 10
USD	1,700,000	JB POINDEXTER 8. 7500% 15/12/31 144A	1, 754, 597	0. 10
USD	1, 758, 000	FORTRESS TRAN 6.5000% 01/10/25 144A	1, 753, 494	0.10
USD	1, 725, 000	WR GRACE HOLD 7. 3750% 01/03/31 144A	1, 751, 179	0.10
USD	2, 075, 000	STANDARD INDS 3.3750% 15/01/31 144A	1, 741, 137	0. 10
USD	2,075,000	MPT OP PTNR/FINL 5. 0000% 15/10/27	1, 733, 559	0.10
USD	2,000,000	NRG ENERGY IN 3. 6250% 15/02/31 144A	1, 725, 046	0. 10
USD	1, 700, 000	PGT INNOVATIO 4. 3750% 01/10/29 144A	1, 724, 866	0. 10
USD	1, 725, 000	NABORS INDS I 7. 3750% 15/05/27 144A	1, 721, 509	0. 10
				0. 10
USD	1, 850, 000	ALLEGHENY TECH 5. 1250% 01/10/31	1, 714, 825	
USD	1, 675, 000	DELEK LOG PT/ 8. 6250% 15/03/29 144A	1, 711, 940	0.10
USD	1, 725, 000	ALBERTSONS CO 5. 8750% 15/02/28 144A	1, 708, 449	0. 10
USD	1,700,000	HERBALIFE/HLF 7. 8750% 01/09/25 144A	1, 705, 284	0.10
USD	1,800,000	UNITED WHOLES 5.5000% 15/04/29 144A	1, 700, 977	0.10
USD	1, 900, 000	HILTON GRAND 4.8750% 01/07/31 144A	1, 698, 478	0.10
USD	1, 700, 000	FREEDOM MORTG 7. 6250% 01/05/26 144A	1, 697, 868	0.10
USD	1,675,000	CAESARS ENT 6.5000% 15/02/32 144A	1, 690, 254	0.10
USD	1,650,000	MATADOR RESOU 6.8750% 15/04/28 144A	1, 687, 028	0.10
USD	1,650,000	MAUSER PACKAG 7.8750% 15/08/26 144A	1, 676, 677	0.10
USD	1, 875, 000	UNIVISION COM 4.5000% 01/05/29 144A	1, 674, 993	0.10
USD	1, 875, 000	CHARLES RIVER 4.0000% 15/03/31 144A	1, 672, 441	0.10
USD	1, 800, 000	SUNOCO LP/FIN 4.5000% 15/05/29	1,671,274	0.10
USD	1,650,000	KEHE DIS/FIN/ 9.0000% 15/02/29 144A	1, 671, 118	0.10
USD	2,073,000	ARDAGH METAL 4.0000% 01/09/29 144A	1,669,195	0.10
USD	1, 775, 000	PARK-OHIO INDUST 6.6250% 15/04/27	1,660,389	0.10
USD	1, 775, 000	AVIS BUDGET C 4.7500% 01/04/28 144A	1,640,190	0.10
USD	1,650,000	TARGA RES PRTNRS 5.5000% 01/03/30	1,632,891	0.10
USD	1, 650, 000	CEDAR FAIR LP 5. 3750% 15/04/27	1, 625, 349	0. 10
USD	1, 975, 000	VICTORIA'S SE 4. 6250% 15/07/29 144A	1, 622, 133	0.10
USD	1, 625, 000	FIRSTCASH INC 6. 8750% 01/03/32 144A	1, 619, 237	0.10
USD	1, 775, 000	PENNYMAC FIN 4. 2500% 15/02/29 144A	1, 617, 986	0. 10
USD	1,725,000	IRON MOUNTAIN 4. 8750% 15/09/29 144A	1, 616, 837	0. 10
USD	1, 725, 000	COMPASS MIN I 6. 7500% 01/12/27 144A	1, 614, 634	0. 10
USD	1, 700, 000	MURPHY OIL USA 4.7500% 15/09/29	1, 602, 462	0.10
USD	1,650,000	FREEDOM MORTG 6. 6250% 15/01/27 144A	1,601,819	0.10
USD	1, 525, 000	CITGO PETROLE 8.3750% 15/01/29 144A	1, 598, 247	0.10

通貨	数量/額面(1)	銘柄	評価額	純資産比率(%)	
USD	1, 525, 000	LIFEPOINT HEA 9.8750% 15/08/30 144A	1, 594, 305	0.09	
USD	1, 725, 000	ENERGIZER HLD 4.7500% 15/06/28 144A	1, 591, 220	0.09	
USD	1, 875, 000	WMG ACQUISITI 3. 0000% 15/02/31 144A	1, 583, 879	0.09	
USD	1, 563, 000	DELTA AIR LIN 7. 0000% 01/05/25 144A	1, 583, 726	0.09	
USD	1, 725, 000	TERRAFORM POW 4.7500% 15/01/30 144A	1, 577, 479	0.09	
USD	1, 825, 000	ENLINK MIDSTREAM 5. 4500% 01/06/47	1, 571, 239	0.09	
USD	1, 650, 000	WYNN RESORTS 5. 1250% 01/10/29 144A	1, 562, 601	0.09	
USD	1, 650, 000	ASGN INC 4. 6250% 15/05/28 144A	1, 559, 250	0.09	
USD	1, 550, 000	RHP HOTEL PPT 6. 5000% 01/04/32 144A	1, 557, 029	0.09	
USD	1, 575, 000	ENTEGRIS ESCR 5. 9500 % 01/04/32 144A	1, 556, 495	0.09	
USD	1, 500, 000	CHART INDUSTR 7. 5000% 01/01/30 144A	1, 555, 970	0.09	
USD	1, 675, 000	TENET HEALTHCARE 4. 2500% 01/06/29	1, 555, 612	0.09	
USD	1,600,000	HF SINCLAIR C 5.0000% 01/02/28 144A	1, 552, 256	0.09	
USD	1, 700, 000		1, 549, 665	0.09	
		CROCS INC 4.2500% 15/03/29 144A			
USD	1, 750, 000	ENLINK MIDSTREAM 5. 6000% 01/04/44	1, 548, 859	0. 09 0. 09	
USD	1,600,000	ALBERTSONS CO 4. 6250% 15/01/27 144A	1, 548, 221		
USD	1,600,000	HOSPITALITY PROP 5. 2500% 15/02/26	1, 546, 284	0.09	
USD	1, 675, 000	LCM INVESTMEN 4.8750% 01/05/29 144A	1, 536, 860	0.09	
USD	1, 575, 000	WESTERN DIGITAL 4.7500% 15/02/26	1, 534, 356	0.09	
USD	1, 675, 000	TEGNA INC 4. 6250% 15/03/28	1, 529, 455	0.09	
USD	1, 750, 000	CHEMOURS CO 4. 6250% 15/11/29 144A	1, 527, 817	0.09	
USD	1, 400, 000	CHART INDUSTR 9.5000% 01/01/31 144A	1, 525, 886	0.09	
USD	1, 669, 000	GCI LLC 4.7500% 15/10/28 144A	1, 525, 683	0.09	
USD	1, 526, 000	DIVERSIFIED HLTH 9.7500% 15/06/25	1, 525, 077	0.09	
USD	1, 425, 000	CIVITAS RESOU 8.7500% 01/07/31 144A	1, 524, 629	0.09	
USD	1,650,000	YUM! BRANDS INC 4.6250% 31/01/32	1, 523, 128	0.09	
USD	1, 675, 000	LAMAR MEDIA CORP 4.0000% 15/02/30	1, 522, 777	0.09	
USD	1, 590, 000	BRINK'S CO/TH 4.6250% 15/10/27 144A	1, 507, 903	0.09	
USD	1, 625, 000	US FOODS INC 4.6250% 01/06/30 144A	1, 505, 380	0.09	
USD	1, 450, 000	PERMIAN RESR 7.0000% 15/01/32 144A	1, 503, 144	0.09	
USD	1, 450, 000	FORTRESS TRAN 9.7500% 01/08/27 144A	1, 501, 591	0.09	
USD	1, 525, 000	CHURCHILL DOW 5.5000% 01/04/27 144A	1, 495, 333	0.09	
USD	1, 500, 000	UNITED RENTALS 5.5% 15/05/27	1, 494, 623	0.09	
USD	1, 725, 000	PLAYTIKA HOLD 4. 2500% 15/03/29 144A	1, 492, 937	0.09	
USD	2, 175, 000	MPT OP PTNR/FINL 3.5000% 15/03/31	1, 487, 206	0.09	
USD	1,625,000	EDGEWELL PERS 4.1250% 01/04/29 144A	1, 486, 177	0.09	
USD	1, 500, 000	OLIN CORP 5.6250% 01/08/29	1, 481, 843	0.09	
USD	1, 625, 000	UNITED RENTAL NA 4.0000% 15/07/30	1, 475, 566	0.09	
USD	1, 550, 000	CEDAR FAIR LP 5.2500% 15/07/29	1, 467, 465	0.09	
USD	1, 750, 000	DAVITA INC 3.7500% 15/02/31 144A	1, 464, 816	0.09	
USD	1,600,000	COMMSCOPE FIN 6.0000% 01/03/26 144A	1, 464, 000	0.09	
USD	1, 475, 000	LIVE NATION E 5. 6250% 15/03/26 144A	1, 458, 648	0.09	
USD	1, 425, 000	FRONTIER COMM 8. 7500% 15/05/30 144A	1, 455, 274	0.09	
USD	1,600,000	ATLAS LUXCO 4 4.6250% 01/06/28 144A	1, 454, 704	0.09	
USD	1, 775, 000	CHS/COMMUNITY 5. 2500% 15/05/30 144A	1, 448, 961	0.09	
USD	2, 075, 000	IHEARTCOMMUNI 4. 7500% 15/01/28 144A	1, 448, 226	0.09	
USD	1, 425, 000	USA PART/USA 7. 1250% 15/03/29 144A	1, 448, 143	0.09	
USD	1, 420, 000	BELLRING DIST 7. 0000% 15/03/30 144A	1, 444, 800	0.09	
USD	1, 400, 000	KB HOME 6.8750% 15/06/27	1, 444, 285	0.09	
USD	1, 400, 000	NGL EN OP/FIN 8. 3750% 15/02/32 144A	1, 434, 981	0.09	
USD	1, 325, 000	AMERITEX HOL 10. 2500% 15/10/28 144A	1, 425, 744	0.09	
				0.08	
USD	1, 450, 000	PERFORMANCE F 5. 5000% 15/10/27 144A	1, 423, 758		
USD	1, 400, 000	BUILDERS FIRS 6. 3750% 15/06/32 144A	1, 420, 803	0.08	
USD	1, 550, 000	SUBURBAN PROP 5. 0000% 01/06/31 144A	1, 412, 065	0.08	
USD	1, 975, 000	AMC NETWORKS INC 4. 2500% 15/02/29	1, 411, 588	0.08	
USD	1, 475, 000	NATIONSTAR MT 5.5000% 15/08/28 144A	1, 410, 098	0.08	
USD	1, 375, 000	XPO INC 7. 1250% 01/06/31 144A	1, 409, 726	0.08	
USD	1, 425, 000	ANTERO MIDSTR 5. 7500% 01/03/27 144A	1, 407, 327	0.08	
USD	1, 500, 000	PETSMART INC/ 4. 7500% 15/02/28 144A	1, 402, 435	0.08	
USD	1, 475, 000	TRANSMONTAIGE 6. 1250% 15/02/26	1, 400, 228	0. 08	
USD	1, 600, 000	SONIC AUTOMOT 4. 8750% 15/11/31 144A	1, 396, 834	0.08	
USD	1, 425, 000	CNX RESOURCES 6.0000% 15/01/29 144A	1, 396, 453	0.08	

通貨	数量/額面(1)	銘柄	評価額	純資産比率(%)	
USD	1, 550, 000	VENTURE GLOBA 3.8750% 15/08/29 144A	1, 388, 736	0.08	
USD	1, 525, 000	TRIMAS CORP 4. 1250% 15/04/29 144A	1, 383, 958	0.08	
USD	1,900,000	SINCLAIR TELE 4. 1250% 01/12/30 144A	1, 381, 737	0.08	
USD	1, 375, 000	XHR LP 6. 3750% 15/08/25 144A	1, 376, 169	0.08	
USD	1, 375, 000	ENACT HLDGS I 6.5% 15/08/25 144A	1, 373, 941	0.08	
USD	1, 525, 000	GO DADDY OP/F 3.5000% 01/03/29 144A	1, 373, 941	0.08	
USD	1, 300, 000	LGI HOMES INC 8. 7500% 15/12/28 144A	1, 372, 264	0.08	
USD	1, 375, 000	POLYONE CORP 5. 7500% 15/05/25 144A	1, 368, 158	0.08	
USD	1, 350, 000	STARWOOD PROP 7. 2500% 01/04/29 144A	1, 365, 791	0.08	
USD	1, 433, 000	ADTALEM GLOBA 5. 5000% 01/03/28 144A	1, 364, 961	0.08	
USD	1, 400, 000	SUMMIT MATERI 5. 2500% 15/01/29 144A	1, 363, 325	0.08	
USD	1, 225, 000	NAVIENT CORP 11. 5000% 15/03/31	1, 360, 865	0. 08	
USD	1, 425, 000	ACADIA HEALTH 5.0000% 15/04/29 144A	1, 353, 117	0. 08	
USD	1, 325, 000	L BRANDS INC 6.6250% 01/10/30 144A	1, 351, 819	0. 08	
USD	1, 350, 000	EQM MIDSTREAM 6.0000% 01/07/25 144A	1, 351, 304	0.08	
USD	1, 300, 000	ADAMS HOMES I 9. 2500% 15/10/28 144A	1, 350, 590	0.08	
USD	1, 450, 000	CCO HOLDINGS 5.0000% 01/02/28 144A	1, 349, 408	0.08	
USD	1, 250, 000	BRAND INDUST 10.3750% 01/08/30 144A	1, 348, 814	0.08	
USD	1, 350, 000	MGM RESORTS 6.5000% 15/04/32	1, 347, 634	0.08	
USD	1, 325, 000	SERVICE PROP 7.5000% 15/09/25	1, 341, 294	0.08	
USD	1, 400, 000	HOWARD HUGHES 5. 3750% 01/08/28 144A	1, 340, 022	0.08	
USD	1, 300, 000	LIGHT & WONDE 7. 2500% 15/11/29 144A	1, 335, 242	0.08	
USD	1, 375, 000	MGIC INVT CORP 5. 2500% 15/08/28	1, 333, 967	0.08	
USD	1, 325, 000	BUILDERS FIRS 6.3750% 01/03/34 144A	1, 332, 267	0.08	
USD	1, 275, 000	PBF HOLDING C 7.8750% 15/09/30 144A	1, 323, 553	0.08	
USD	1, 350, 000	SPECTRUM BRAN 5.5000% 15/07/30 144A	1, 320, 669	0.08	
USD	1, 325, 000	CLEAR CHANNEL 7. 8750% 01/04/30 144A	1, 318, 073	0. 08	
USD	1, 385, 000	COMPASS GRP L 5. 2500% 15/04/29 144A	1, 316, 568	0.08	
USD	1, 525, 000	SCOTTS MIRACLE 4.0000% 01/04/31	1, 311, 280	0.08	
USD	1, 325, 000	ALLEGHENY TECH 5. 8750% 01/12/27	1, 305, 994	0.08	
USD	1, 375, 000	WILLIAMS SCOT 4. 6250% 15/08/28 144A	1, 299, 164	0.08	
USD	1, 350, 000	APX GROUP 5. 7500% 15/07/29 144A	1, 297, 145	0.08	
USD	1, 425, 000	WESTERN GAS PARTNERS 5. 45% 1/04/44	1, 296, 021	0.08	
USD	1, 375, 000	COEUR MINING 5. 1250% 15/02/29 144A	1, 295, 462	0.08	
USD	1, 325, 000	IQVIA INC 5.0000% 15/05/27 144A	1, 293, 402	0.08	
		HILCORP ENERG 5. 7500% 01/02/29 144A		0.08	
USD	1, 325, 000		1, 290, 303		
USD	1, 475, 000	QUICKEN LOANS 3. 8750% 01/03/31 144A	1, 286, 657	0.08	
USD	1, 150, 000	SPIRIT AEROSY 9. 7500% 15/11/30 144A	1, 285, 019	0.08	
USD	1, 375, 000	NCR VOYIX COR 5. 0000% 01/10/28 144A	1, 281, 060	0.08	
USD	1, 300, 000	LABL INC 6. 7500% 15/07/26 144A	1, 280, 802	0.08	
USD	1, 375, 000	CTR PARTNERSH 3.8750% 30/06/28 144A	1, 274, 383	0. 08	
USD	1, 223, 000	LEVEL 3 FIN 10.5000% 15/05/30 144A	1, 271, 920	0.08	
USD	1, 475, 000	HILTON DOMEST 3.6250% 15/02/32 144A	1, 266, 967	0.08	
USD	1, 375, 000	HESS MIDSTREA 4.2500% 15/02/30 144A	1, 261, 865	0.08	
USD	1, 200, 000	WINDSOR HOLDI 8.5000% 15/06/30 144A	1, 258, 711	0.07	
USD	1, 225, 000	PENNYMAC FIN 7.8750% 15/12/29 144A	1, 257, 369	0.07	
USD	1, 250, 000	BLUE RACER MI 7.6250% 15/12/25 144A	1, 256, 601	0.07	
USD	1,825,000	DISH DBS CORP 5.7500% 01/12/28 144A	1, 254, 344	0.07	
USD	1, 475, 000	BALL CORP 3. 1250% 15/09/31	1, 250, 329	0.07	
USD	1, 200, 000	BREAD FINANCI 9.7500% 15/03/29 144A	1, 249, 658	0.07	
USD	1, 225, 000	TENET HEALTHC 6.7500% 15/05/31 144A	1, 248, 941	0.07	
USD	1, 325, 000	HAWAIIAN BRAN 5.7500% 20/01/26 144A	1, 244, 709	0.07	
USD	1, 350, 000	ON SEMICONDUC 3.8750% 01/09/28 144A	1, 241, 636	0.07	
USD	1, 275, 000	MOHEGAN TRIBA 8. 0000% 01/02/26 144A	1, 240, 945	0. 07	
USD	1, 175, 000	ZF NA CAPITAL 7. 1250% 14/04/30 144A	1, 240, 564	0. 07	
USD	1, 725, 000	IHEARTCOMMUNI 5. 2500% 15/08/27 144A	1, 239, 254	0. 07	
USD	1, 400, 000	CONSENSUS CLO 6. 5000% 15/10/28 144A	1, 238, 552	0.07	
USD	1, 350, 000	SINCLAIR TELE 5. 125% 15/02/27 144A	1, 235, 352	0.07	
USD	1, 325, 000	HOSPITALITY PROP 4. 7500% 01/10/26		0.07	
			1, 233, 088	0.07	
USD	1, 350, 000	ADT SEC CORP 4. 1250% 01/08/29 144A	1, 232, 631		
USD	1, 350, 000	ITT HOLDINGS 6. 5000% 01/08/29 144A	1, 229, 468	0. 07 0. 07	
USD	1, 275, 000	VICI PROPERTI 4.2500% 01/12/26 144A	1, 226, 280	0.07	

通貨	数量/額面(1)	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	1, 400, 000	MACYS RETAIL HLD 5.1250% 15/01/42	1, 217, 602	0. 07
USD	1, 225, 000	ALLISON TRANS 5.8750% 01/06/29 144A	1, 212, 051	0.07
USD	1, 375, 000	COVANTA HOLDING 5.0000% 01/09/30	1, 210, 758	0. 07
USD	1, 175, 000	BALL CORP 6. 8750% 15/03/28	1, 207, 295	0.07
USD	1, 175, 000	NORTONLIFELOC 7. 1250% 30/09/30 144A	1, 206, 591	0.07
USD	1, 250, 000	VISTRA OPERAT 5.0000% 31/07/27 144A	1, 206, 176	0.07
USD	1, 240, 000	SCIL IV LLC / 5.3750% 01/11/26 144A	1, 205, 509	0.07
USD	1, 200, 000	USA PART/USA FIN 6.8750% 01/09/27	1, 201, 987	0.07
USD	1, 190, 000	AMERIGAS PARTNER 5.8750% 20/08/26	1, 187, 069	0.07
USD	1,800,000	GRAY ESCROW I 5. 3750% 15/11/31 144A	1, 183, 409	0.07
USD	1, 325, 000	MSCI INC 3.6250% 01/09/30 144A	1, 176, 962	0.07
USD	1,000,000	FORD MOTOR CO 9. 6250% 22/04/30	1, 171, 982	0.07
USD	1, 175, 000	PRIME HEALTHC 7. 2500% 01/11/25 144A	1, 169, 689	0.07
USD	1, 125, 000	RAIN CARBON 12. 2500% 01/09/29 144A	1, 164, 247	0.07
USD	1,500,000	CHS/COMMUNITY 4.7500% 15/02/31 144A	1, 162, 708	0.07
USD	1, 250, 000	SOTHEBY'S 7. 3750% 15/10/27 144A ARSENAL AIC P 8. 0000% 01/10/30 144A	1, 162, 332	0. 07 0. 07
USD USD	1, 100, 000 1, 150, 000	CLEAN HARBORS 6. 3750% 01/10/30 144A	1, 157, 859 1, 157, 069	0.07
USD	1, 150, 000	CIVITAS RESOU 8. 6250% 01/11/30 144A	1, 157, 009	0.07
USD	1, 150, 000	ANTERO MIDSTR 6. 6250% 01/02/32 144A	1, 154, 639	0.07
USD	1, 125, 000	NGL EN OP/FIN 8. 1250% 15/02/29 144A	1, 150, 523	0.07
USD	1, 550, 000	GRAFTECH GLOB 9. 8750% 15/12/28 144A	1, 149, 568	0.07
USD	1, 225, 000	EQM MIDSTREAM 4.5000% 15/01/29 144A	1, 148, 896	0. 07
USD	1, 200, 000	HILTON DOMESTIC 4. 8750% 15/01/30 WI	1, 148, 631	0. 07
USD	1, 325, 000	HILLENBRAND INC 3.7500% 01/03/31	1, 147, 371	0. 07
USD	1, 750, 000	GRAY TELE INC 4.7500% 15/10/30 144A	1, 146, 730	0. 07
USD	1, 125, 000	UNIVISION COM 8.0000% 15/08/28 144A	1, 146, 310	0.07
USD	1, 250, 000	OWENS & MINOR 4.5000% 31/03/29 144A	1, 143, 961	0.07
USD	1, 200, 000	NESCO HOLDING 5.5000% 15/04/29 144A	1, 132, 502	0.07
USD	1, 125, 000	MITR BRDN / M 6.7500% 01/04/32 144A	1, 131, 463	0.07
USD	1, 125, 000	TALLGRASS NRG 7.3750% 15/02/29 144A	1, 129, 385	0.07
USD	1, 250, 000	ALBERTSONS CO 3.5000% 15/03/29 144A	1, 124, 980	0.07
USD	1, 050, 000	TALEN ENERGY 8. 6250% 01/06/30 144A	1, 124, 212	0. 07
USD	1, 175, 000	FORESTAR GROU 3. 8500% 15/05/26 144A	1, 123, 868	0. 07
USD	1, 150, 000	ICAHN ENTER/FIN 6. 2500% 15/05/26 WI	1, 123, 765	0.07
USD	1, 200, 000	LADDER CAP FI 4. 2500% 01/02/27 144A	1, 122, 395	0.07
USD	1, 325, 000	VENTURE GLOBA 3. 8750% 01/11/33 144A	1, 122, 370	0.07
USD USD	1, 175, 000	SHEA HOMES 4.7500% 15/02/28 SIMMONS FOODS 4.6250% 01/03/29 144A	1, 116, 243	0. 07 0. 07
USD	1, 275, 000 1, 100, 000	SOLARIS MIDST 7. 6250% 01/03/29 144A SOLARIS MIDST 7. 6250% 01/04/26 144A	1, 113, 428 1, 111, 204	0.07
USD	1, 150, 000	UNITED AIRLIN 4. 3750% 15/04/26 144A	1, 111, 204	0.07
USD	1, 150, 000	CDI ESCROW IS 5.7500% 01/04/30 144A	1, 110, 136	0.07
USD	1, 300, 000	APACHE CORP 5. 1000% 01/09/40	1, 109, 642	0. 07
USD	1, 200, 000	BOYNE USA 4.7500% 15/05/29 144A	1, 108, 287	0. 07
USD	1, 375, 000	NEWELL RUBBERMAI 5. 7500% 01/04/46	1, 100, 067	0. 07
USD	1, 100, 000	AMERIGAS PART/FIN 5.5% 20/05/25	1, 099, 676	0. 07
USD	1, 075, 000	VITAL ENERGY 7.8750% 15/04/32 144A	1,096,360	0.07
USD	1, 150, 000	ALBERTSONS CO 4.8750% 15/02/30 144A	1, 093, 548	0.07
USD	1, 175, 000	MIDWEST GMNG 4.8750% 01/05/29 144A	1,088,432	0.06
USD	1, 075, 000	TRANSDIGM INC 6.6250% 01/03/32 144A	1, 084, 543	0.06
USD	1, 250, 000	WESTERN GAS PART 5.3000% 01/03/48	1, 083, 115	0.06
USD	1, 025, 000	CALLON PETROL 7.5000% 15/06/30 144A	1, 082, 087	0.06
USD	1, 225, 000	SERVICE CORP 4.0000% 15/05/31	1, 082, 069	0.06
USD	1, 100, 000	AMERIGAS PART/FIN 5.75% 20/05/27	1, 074, 387	0.06
USD	1, 225, 000	MERCER INTL INC 5. 1250% 01/02/29 WI	1, 072, 846	0.06
USD	1, 150, 000	MATTEL INC 5. 4500% 01/11/41	1, 063, 818	0.06
USD	1, 200, 000	RLJ LDGING TR 4. 0000% 15/09/29 144A	1, 057, 553	0.06
USD	1, 075, 000	TRI POINTE GROUP 5. 2500% 01/06/27	1, 049, 999	0.06
USD	1, 100, 000	RLJ LDGING TR 3.7500% 01/07/26 144A	1, 046, 716	0.06
USD	1, 100, 000	CENTENE CORP 4. 6250% 15/12/29 WI	1, 042, 827	0.06
USD USD	1, 075, 000 1, 225, 000	FORTRESS TRAN 5.5000% 01/05/28 144A ICAHN ENTER/FIN 4.3750% 01/02/29	1, 040, 439 1, 037, 231	0. 06 0. 06
ענט	1, 220, 000	TOTALLY ENTER/THY T. 0100/0 01/02/20	1,001,201	0.00

通貨	数量/額面(1)	数量/額面 <sup>(1)</sup>		純資産比率(%)
USD	1, 100, 000	HAT HOLDINGS 3.3750% 15/06/26 144A	1,034,600	0.06
USD	1,000,000	PRAIRIE ACQUI 9. 0000% 01/08/29 144A	1, 031, 397	0.06
USD	1, 100, 000	GOODYEAR TIRE 5.0000% 15/07/29	1, 026, 862	0.06
USD	1, 050, 000	IQVIA INC 5. 0000% 15/10/26 144A	1, 026, 499	0.06
USD	1, 075, 000	CONSENSUS CLO 6. 0000 % 15/10/26 144A	1, 026, 206	0.06
USD	1, 175, 000	MOLINA HEALTH 3. 8750% 15/05/32 144A	1, 025, 200	0.00
USD	1, 025, 000	HILTON DOMEST 5. 7500% 01/05/28 144A	1, 023, 113	0.06
USD	1, 150, 000	VENTURE GLOBA 4. 1250% 15/08/31 144A	1, 023, 132	0.06
USD	1, 125, 000	BEACON ROOFIN 4. 1250% 15/05/29 144A	1, 020, 045	0.00
USD	1, 150, 000	YUM! BRANDS INC 3.6250% 15/03/31	1, 018, 426	0.00
USD	1, 130, 000	AMERICAN AIRL 7. 2500% 15/02/28 144A	1, 015, 138	0.06
USD	1,000,000	MOLINA HEALTH 4. 3750% 15/06/28 144A	1, 013, 136	0.06
USD	950, 000	TALOS PRODUCT 9. 3750% 01/02/31 144A	1, 013, 030	0.00
USD	1,000,000	LABL INC 9. 5000% 01/11/28 144A	1, 006, 232	0.06
	950, 000		1,006,232	0.06
USD		TALOS PRODUCT 9. 0000% 01/02/29 144A		0.06
USD	1,000,000	CENTURY COMMUNIT 6. 7500% 01/06/27	1, 005, 931	0.06
USD	975, 000	TRANSDIGM INC 7. 1250% 01/12/31 144A	1, 004, 745	
USD	1,000,000	CLEVELAND-CLI 6. 7500% 15/04/30 144A	1, 002, 155	0.06
USD	1,050,000	TAYLOR MORRIS 5. 1250% 01/08/30 144A	1,000,644	0.06
USD	950, 000	CIVITAS RESOU 8. 3750% 01/07/28 144A	1,000,236	0.06
USD	1, 125, 000	MOLINA HEALTH 3. 8750% 15/11/30 144A	1,000,023	0.06
USD	1,025,000	JEFFERSON CAP 6. 0000% 15/08/26 144A	999, 739	0.06
USD	1,000,000	NUSTAR LOGISTICS 5.7500% 01/10/25	995, 954	0.06
USD	975, 000	FRONTIER COMM 8. 6250% 15/03/31 144A	994, 341	0.06
USD	1, 300, 000	CCO HOLDINGS 4. 2500% 15/01/34 144A	979, 354	0.06
USD	925, 000	NORTHERN OIL 8. 7500% 15/06/31 144A	977, 740	0.06
USD	975, 000	FXI HOLDINGS 12. 2500% 15/11/26 144A	976, 219	0.06
USD	1,000,000	EDGEWELL PERS 5.5000% 01/06/28 144A	975, 905	0.06
USD	1, 025, 000	TENET HEALTHCARE 4.6250% 15/06/28	975, 323	0.06
USD	1, 100, 000	KB HOME 4.0000% 15/06/31	972, 747	0.06
USD	950, 000	STL HOLDING C 8.7500% 15/02/29 144A	972, 302	0.06
USD	1, 050, 000	CALPINE CORP 4.6250% 01/02/29 144A	971, 099	0.06
USD	925, 000	LCM INVESTMEN 8.2500% 01/08/31 144A	966, 422	0.06
USD	925, 000	NOBLE FIN II 8.0000% 15/04/30 144A	963, 774	0.06
USD	1,000,000	FORD MOTOR CRED 4.2710% 09/01/27	963, 686	0.06
USD	1, 225, 000	MPH ACQUISITI 5.7500% 01/11/28 144A	961, 598	0.06
USD	1,000,000	CATALENT PHAR 3.5000% 01/04/30 144A	959, 211	0.06
USD	1,000,000	NRG ENERGY IN 5.2500% 15/06/29 144A	958, 173	0.06
USD	1,000,000	MATCH GROUP I 5.0000% 15/12/27 144A	957, 515	0.06
USD	1,025,000	TALLGRASS NRG 6.0000% 01/09/31 144A	954, 788	0.06
USD	975, 000	HOSPITALITY PROP 4. 5000% 15/03/25	954, 371	0.06
USD	1,000,000	ALBERTSONS CO 3.2500% 15/03/26 144A	953, 615	0.06
USD	1,000,000	COMSTOCK RE I 6.7500% 01/03/29 144A	952, 558	0.06
USD	1,050,000	TTM TECHNOLOG 4.0000% 01/03/29 144A	952, 350	0.06
USD	1,025,000	MSCI INC 4.0000% 15/11/29 144A	943, 829	0.06
USD	750, 000	ASCENT RESOUR 9.0000% 01/11/27 144A	943, 121	0.06
USD	975, 000	BOYD GAMING CORP 4.7500% 01/12/27	941, 072	0.06
USD	1,000,000	SHEA HOMES 4.7500% 01/04/29	937, 322	0.06
USD	900,000	ICAHN ENTER/F 9.7500% 15/01/29 144A	936, 437	0.06
USD	925, 000	GEN DIGITAL I 6.7500% 30/09/27 144A	936, 402	0.06
USD	1, 050, 000	BLACKSTONE MT 3.7500% 15/01/27 144A	935, 511	0.06
USD	1,000,000	ROCKCLIFF ENE 5.5000% 15/10/29 144A	931, 986	0.06
USD	1, 050, 000	NRG ENERGY IN 3.3750% 15/02/29 144A	930, 685	0.06
USD	900,000	ZF NA CAPITAL 6.8750% 14/04/28 144A	930, 460	0.06
USD	975, 000	LIFEPOINT HEA 4.3750% 15/02/27 144A	928, 955	0, 06
USD	925, 000	BLUE RACER MI 6. 6250% 15/07/26 144A	923, 280	0.06
USD	900, 000	SUNOCO LP/FIN 7. 0000% 15/09/28 144A	918, 942	0.00
USD	900, 000	OWENS-BROCKWA 7. 2500% 15/05/31 144A	913, 927	0.05
USD	1, 275, 000	COMMSCOPE INC 4.7500% 01/09/29 144A	911, 625	0.05
USD	1, 050, 000	SENSATA TECHN 3.7500% 15/02/31 144A	906, 907	0.05
USD	1,000,000	ATLAS LUXCO 4 4.6250% 01/06/28 144A	903, 784	0.05
USD	900, 000	MANITOWOC CO 9. 0000% 01/04/26 144A	899, 421	0.05
002	,		000, 121	

USD 900,000 SLMMIT MATERI 6, 5000% 15/03/27 144A 898, 549 0.05 USD 875,000 AVENT CORP 7, 1260% 01/08/30 144A 888, 319 0.05 USD 1,000,000 ANN HEALTHCAR 4, 0000% 15/04/29 144A 887, 446 0.05 USD 1,000,000 ANN HEALTHCAR 4, 0000% 15/04/29 144A 887, 446 0.05 USD 1,000,000 ANN HEALTHCAR 4, 0000% 15/04/29 144A 887, 446 0.05 USD 1,000,000 UNITED RENTAL NA 3, 875, 875, 875, 875, 875, 875, 875, 875		数量/額面(1)	銘柄	評価額	純資産比率(%)	
USD 875,000 AVIENT CORP 7, 1250% 01/08/30 144A 898, 319 0.05 USD 1,000,000 AMINERALTHCAR 4,000% 15/04/29 144A 896, 481 0.05 USD 1,000,000 ANN HEALTHCAR 4,000% 15/04/29 144A 896, 481 0.05 USD 1,000,000 LONTED RENTAL NA 3,8750% 01/16/29 144A 896, 481 0.05 USD 1,000,000 UNITED RENTAL NA 3,8750% 01/05/231 894,559 0.05 USD 825,000 RAISENC CANE 9,3750% 01/05/29 144A 881,129 0.05 USD 850,000 RAISENC CANE 9,3750% 01/05/29 144A 881,129 0.05 USD 850,000 LONE STREET G 4,5000% 15/06/231 144A 881,129 0.05 USD 850,000 LONE STREET G 4,5000% 15/06/231 144A 889, 226 USD 850,000 LONE STREET G 4,5000% 15/06/231 144A 889, 236 USD 1,925,000 LEVEL 3 PIN 13,7500% 15/06/231 144A 889, 883 0.05 USD 1,925,000 LEVEL 3 PIN 13,7500% 15/06/231 144A 886, 250 0.05 USD 1,025,000 LEVEL 3 PIN 13,7500% 15/06/231 144A 886, 250 0.05 USD 1,025,000 LEVEL 3 PIN 13,7500% 15/06/231 144A 886, 250 0.05 USD 1,100,000 SUNDOVA ENERG 5,8750% 16/10/31 144A 886, 250 0.05 USD 1,205,000 CATALENT PHAR 3,1250% 15/04/30 883, 292 0.05 USD 1,000,000 CATALENT PHAR 3,1250% 15/04/29 144A 883, 141 0.05 USD 800,000 CATALENT PHAR 3,1250% 15/04/29 144A 881, 181 0.05 USD 800,000 CATALENT PHAR 3,1250% 15/04/29 144A 881, 181 0.05 USD 800,000 CATALENT PHAR 3,1250% 15/04/29 144A 881, 181 0.05 USD 800,000 CATALENT PHAR 3,1250% 15/04/29 144A 881, 181 0.05 USD 800,000 CATALENT PHAR 3,1250% 15/04/29 144A 881, 181 0.05 USD 800,000 CATALENT PHAR 3,1300% 15/04/39 883,392 0.05 USD 800,000 CATALENT PHAR 3,1300% 15/04/39 883,392 0.05 USD 800,000 MICHAEL SCORE 5,2500% 10/05/29 144A 881, 181 0.05 USD 800,000 MICHAEL SCORE 5,2500% 10/05/29 144A 881, 181 0.05 USD 800,000 MICHAEL SCORE 5,2500% 10/05/29 144A 881, 181 0.05 USD 800,000 FIRM FROM FROM FROM FROM FROM FROM FROM FR	LICD	000 000	CUMMIT MATERIA C 50000/ 15/00/07 1444		0.05	
USD 1, 000, 000 AMN HEALTHCAR 4, 0000% 15/04/29 144A 896, 481 0, 0.5 USD 1, 025, 000 POST HOLDINGS 4, 5000% 15/09/29 144A 896, 481 0, 0.5 USD 1, 025, 000 UNTED REVIAL NA 3, 3756% 15/02/29 144A 896, 180 0, 0.5 USD 1, 000, 000 UNTED REVIAL NA 3, 3756% 15/02/29 144A 896, 180 0, 0.5 USD 825, 000 RAISENG CANE 9, 3750% 01/05/29 144A 881, 129 0, 0.5 USD 850, 000 PORTAM FINDERS 2, 3500% 15/08/29 144A 882, 236 0, 0.5 USD 850, 000 PORTAM FINDERS 2, 3500% 15/08/29 144A 882, 236 0, 0.5 USD 950, 000 PORTAM FINDERS 2, 3500% 15/08/29 144A 882, 236 0, 0.5 USD 950, 000 PORTAM FINDERS 2, 3500% 15/08/29 144A 889, 883 0, 0.5 USD 1, 925, 000 LEVEL 3 FIN 1 3, 7500% 15/07/29 144A 866, 250 0, 0.5 USD 1, 925, 000 GAP INC/THE 3, 8750% 01/09/25 144A 866, 250 0, 0.5 USD 1, 1025, 000 GAP INC/THE 3, 8750% 01/09/25 144A 883, 243 0, 0.5 USD 1, 1025, 000 GAP INC/THE 3, 8750% 15/07/29 144A 866, 243 0, 0.5 USD 1, 1025, 000 GAP INC/THE 3, 8750% 15/07/29 144A 883, 243 0, 0.5 USD 1, 1025, 000 GAP INC/THE 3, 8750% 15/07/29 144A 883, 243 0, 0.5 USD 1, 1025, 000 GENERAL SERGERY 8, 8750% 15/07/29 144A 883, 243 0, 0.5 USD 1, 1025, 000 GENERAL SERGERY 8, 8750% 15/07/29 144A 883, 241 0, 0.5 USD 1, 1025, 000 GENERAL SERGERY 8, 8750% 15/07/29 144A 883, 241 0, 0.5 USD 1, 1025, 000 GENERAL SERGERY 8, 1025,						
USD 1, 000, 000 POST HOLDINGS 4,5000% 15/09/31 144A 896, 481 0, 0.5 USD 1, 005, 000 GAP INC/THE 3,6259% 01/10/29 144A 896, 180 0, 0.5 USD 1, 000, 000 UNITED RENTAL NA 3,8750% 01/50/2/31 894,559 0, 0.5 USD 825, 000 RAISING CANE* 9, 3750% 01/50/29 144A 881, 129 0, 0.5 USD 825, 000 PARSING CANE* 9, 3750% 01/50/29 144A 881, 129 0, 0.5 USD 825, 000 DRAM FEDERS 8, 2500% 15/60/29 144A 883, 326 0, 0.6 USD 850, 000 DRAM FEDERS 8, 2500% 15/60/29 144A 883, 326 0, 0.6 USD 850, 000 DRAM FEDERS 8, 2500% 15/60/29 144A 883, 326 0, 0.6 USD 850, 000 LEVEL 3 FIN 13, 7500% 15/70/231 144A 866, 550 0, 0.5 USD 1, 925, 000 LEVEL 3 FIN 13, 7500% 15/70/231 144A 866, 550 0, 0.5 USD 1, 925, 000 LEVEL 3 FIN 13, 7500% 15/70/231 144A 866, 550 0, 0.5 USD 1, 100, 000 SUNDVA ENERG 5, 8750% 01/9/26 144A 863, 741 0, 0.5 USD 825, 000 CATALENT PHAR 3, 1250% 15/04/29 144A 863, 741 0, 0.5 USD 825, 000 CATALENT PHAR 3, 1250% 15/04/29 144A 861, 1818 0, 0.5 USD 800, 000 CATALENT PHAR 3, 1250% 15/04/29 144A 861, 1818 0, 0.5 USD 800, 000 CATALENT PHAR 3, 1250% 15/04/29 144A 861, 1818 0, 0.5 USD 800, 000 CATALENT PHAR 3, 1250% 15/04/29 144A 861, 1818 0, 0.5 USD 800, 000 CATALENT PHAR 3, 1250% 15/04/29 144A 861, 1818 0, 0.5 USD 800, 000 CATALENT PHAR 3, 1250% 15/04/29 144A 861, 1818 0, 0.5 USD 800, 000 CATALENT PHAR 3, 1250% 15/04/29 144A 861, 1818 0, 0.5 USD 800, 000 SWATH MATER 7, 2500% 15/04/29 144A 861, 1818 0, 0.5 USD 800, 000 SWATH MATER 7, 2500% 15/04/29 144A 861, 1818 0, 0.5 USD 800, 000 SWATH MATER 7, 2500% 15/04/29 144A 861, 1818 0, 0.5 USD 800, 000 CATALENT PHAR 3, 15/04/39 144A 861, 1818 0, 0.5 USD 800, 000 SWATH MATER 7, 2500% 15/04/29 144A 861, 1818 0, 0.5 USD 800, 000 SWATH MATER 7, 2500% 15/04/29 144A 861, 1818 0, 0.5 USD 800, 000 SWATH MATER 7, 2500% 15/04/29 144A 861, 1818 0, 0.5 USD 800, 000 SWATH MATER 7, 2500% 15/04/29 144A 861, 1818 0, 0.5 USD 800, 000 SWATH MATER 7, 2500% 15/04/29 144A 861, 1818 0, 0.5 USD 800, 000 SWATH MATER 7, 2500% 15/04/29 144A 861, 1818 0, 0.5 USD 800, 000 SWATH MATER 7, 1250% 15/04/29 144A 861, 1818 0, 0.5 USD						
USD 1, 025, 000 GAP INC/THE 3, 6250% 01/10/29 144A 894, 559 0.05 USD 825, 000 RAISING CANE 9, 3750% 01/05/29 144A 891, 129 0.05 USD 825, 000 FORESTAR GROU 5, 0000% 01/05/29 144A 881, 129 0.05 USD 850, 000 DREAM FINDERS 8, 2500% 15/08/28 144A 888, 792 0.05 USD 850, 000 DREAM FINDERS 8, 2500% 15/08/28 144A 888, 792 0.05 USD 950, 000 HE STREET G 4, 5000% 15/12/29 144A 889, 850 0.05 USD 950, 000 HE STREET G 4, 5000% 15/12/29 144A 889, 850 0.05 USD 1, 025, 000 GAP LEVEL REAM DE 1, 5000% 15/12/29 144A 889, 850 0.05 USD 1, 025, 000 GAP LEVEL REAM DE 1, 5000% 15/12/29 144A 889, 850 0.05 USD 1, 025, 000 GAP LEVEL REAM DE 1, 5000% 15/12/30 144A 886, 850 0.05 USD 1, 025, 000 GAP LEVEL REAM DE 1, 5000% 15/12/30 144A 886, 850 0.05 USD 1, 025, 000 GAP LEVEL REAM DE 1, 5000% 15/12/30 144A 886, 850 0.05 USD 1, 020, 000 CREDIT STREET G 4, 57500% 10/05/13 144A 886, 850 0.05 USD 825, 000 GENESIS EXERCY 8, 87590% 15/02/29 144A 886, 813, 818 0.05 USD 800, 000 CREDIT ACCEPTANC 9, 25000% 15/12/28 886, 966 0.05 USD 800, 000 CREDIT ACCEPTANC 9, 25000% 15/12/28 886, 966 0.05 USD 825, 000 MINITE MATERI 7, 25000% 15/01/23 144A 886, 1818 0.05 USD 875, 000 MINITE MATERI 7, 25000% 15/01/23 144A 886, 128 0.05 USD 775, 000 CARONAL HLD 10, 3750% 01/05/28 144A 846, 128 0.05 USD 800, 000 MINITE MATERI 7, 25000% 15/01/23 144A 844, 642 0.05 USD 800, 000 MINITE MATERI 7, 25000% 15/01/23 144A 844, 642 0.05 USD 800, 000 MINITE MATERI 7, 25000% 10/05/28 144A 844, 642 0.05 USD 800, 000 MINITE MATERI 7, 25000% 10/05/28 144A 844, 642 0.05 USD 800, 000 MINITE MATERI 7, 25000% 10/05/28 144A 844, 642 0.05 USD 800, 000 MINITE MATERI 7, 25000% 10/05/28 144A 844, 642 0.05 USD 800, 000 MINITE MATERI 7, 25000% 10/05/28 144A 844, 642 0.05 USD 800, 000 MINITE MATERI 7, 25000% 10/05/28 144A 844, 642 0.05 USD 800, 000 MINITE MATERI 7, 25000% 10/05/28 144A 844, 642 0.05 USD 800, 000 MINITE MATERI 8, 60000 MINITE MATERIA 8, 600						
USD 1,000,000 UNITED RENTAL NA 3, 8750% 15/02/31 894,559 0.65 USD 825,000 RAISING CANE* 9,3750% 01/05/29 144A 891,129 0.05 USD 925,000 FORESTAR GROU 5,0000% 01/03/28 144A 888,792 0.05 USD 950,000 DRAM PINDERS 8, 2500% 15/04/29 144A 888,236 0.05 USD 950,000 HANESTRANDS 19,000% 15/02/23 144A 889,236 0.05 USD 1,925,000 HANESTRANDS 19,0000% 15/02/31 144A 860,883 0.05 USD 1,925,000 HANESTRANDS 19,0000% 15/02/31 144A 860,883 0.05 USD 1,925,000 HANESTRANDS 19,0000% 15/02/31 144A 866,250 0.05 USD 1,005,000 GAP BACTER 3,7500% 15/07/29 144A 866,250 0.05 USD 1,005,000 GAP BACTER 3,7500% 15/07/29 144A 866,251 44 0.65 USD 800,000 GERESIS ENERCY 8,8750% 15/04/30 862,242 0.05 USD 900,000 CATALENT PHAR 3,1250% 15/02/29 144A 861,818 0.05 USD 800,000 CREDIT ACCEPTANC 9,2500% 15/12/28 860,966 0.05 USD 805,000 SUMIT MATERI 7,2500% 15/01/31 144A 856,1818 0.05 USD 1,000,000 MICHAELS COS 5,2500% 01/05/28 144A 844,642 0.05 USD 1,000,000 MICHAELS COS 5,2500% 01/05/28 144A 844,642 0.05 USD 835,000 USPINOLULE 6,3750% 01/05/28 144A 843,799 0.05 USD 830,000 TOPEUILD CORF 1,1500% 01/07/26 WI 843,876 0.05 USD 830,000 TOPEUILD CORF 1,1500% 01/07/26 WI 843,876 0.05 USD 830,000 TOPEUILD CORF 1,1500% 01/07/26 WI 843,876 0.05 USD 830,000 TOPEUILD CORF 1,1500% 01/07/26 WI 843,876 0.05 USD 830,000 TOPEUILD CORF 1,1500% 01/07/26 WI 843,876 0.05 USD 830,000 TOPEUILD CORF 1,1500% 01/07/26 WI 843,876 0.05 USD 830,000 TOPEUILD CORF 1,1500% 01/07/28 WI 844 849,799 0.05 USD 830,000 TOPEUILD CORF 1,1500% 01/07/29 WI 844 849,799 0.05 USD 830,000 TOPEUILD CORF 1,1500% 01/07/29 WI 844 849,799 0.05 USD 830,000 TOPEUILD CORF 1,1500% 01/07/29 WI 844 849,799 0.05 USD 830,000 TOPEUILD CORF 1,1500% 01/07/29 WI 844 849,799 0.05 USD 830,000 TOPEUILD CORF 1,1500% 01/07/29 WI 844 849,799 0.05 USD 830,000 TOPEUILD CORF 1,1500% 01/07/29 WI 844						
USD 925,000 PRESTAR GROU 5,0009% 01/05/29 144A 881,729 0.05 USD 850,000 DREAM PINDERS 8,2500% 15/08/28 144A 888, 792 0.05 USD 850,000 JARE STREET G 4,5000% 15/10/29 144A 879,407 0.05 USD 850,000 JARE STREET G 4,5000% 15/10/29 144A 879,407 0.05 USD 850,000 LEVEL 3 FIN 13,7500% 15/07/29 144A 866,260 0.05 USD 1,925,000 LEVEL 3 FIN 13,7500% 15/07/29 144A 866,260 0.05 USD 1,025,000 LEVEL 3 FIN 13,7500% 15/07/29 144A 866,260 0.05 USD 1,005,000 GAP INC/THE 3,8750% 01/10/31 144A 866,243 0.05 USD 1,005,000 GAP INC/THE 3,8750% 01/10/31 144A 866,243 0.05 USD 825,000 GENESIS ENERGY 8,8750% 01/20/20 144A 861,1818 0.05 USD 900,000 CATALENT PIARS 1,2260% 15/02/29 144A 861,818 0.05 USD 900,000 CATALENT PIARS 1,2260% 15/02/29 144A 861,818 0.05 USD 900,000 CATALENT PIARS 1,2260% 15/02/29 144A 861,818 0.05 USD 900,000 MICHAELST COES 2,5000% 10/57/29 144A 861,818 0.05 USD 900,000 MICHAELST COES 2,5000% 10/57/29 144A 861,128 0.05 USD 775,000 CARONIAL HILD 10,3750% 01/05/29 144A 844,642 0.05 USD 825,000 US FOODS INC 6,8750% 10/05/29 144A 844,642 0.05 USD 825,000 US FOODS INC 6,8750% 10/05/29 144A 844,7379 0.05 USD 825,000 TOPEBULD CORP 4,1250% 15/06/29 144A 844,7379 0.05 USD 800,000 FORD MOTTOR CRED 7,3500% 01/07/26 WISD 843,876 0.05 USD 800,000 FORD MOTTOR CRED 7,3500% 01/07/26 WISD 800,000 FORD MOTTOR CRED 7,3500% 01/07/29 H44A 840,767 0.05 USD 800,000 FORD MOTTOR CRED 7,3500% 01/07/29 H44A 840,767 0.05 USD 800,000 FORD MOTTOR CRED 7,3500% 01/07/29 H44A 840,767 0.05 USD 800,000 FORD MOTTOR CRED 7,3500% 01/07/29 H44A 836,676 0.05 USD 800,000 FORD MOTTOR CRED 7,3500% 01/07/29 H44A 836,676 0.05 USD 800,000 FORD MOTTOR CRED 7,3500% 01/07/29 H44A 830,061 0.05 USD 800,000 FORD MOTTOR CRED 7,3500% 01/07/29 H44A 830,061 0.05 USD 800,000 FORD MOTTOR CRED 7,3500% 01/07/29 H44A 830,061 0.05 USD 800,000 FORD MOTTOR CRED 7,3500% 01/07/29 H44A 830,061 0.05 USD 800,000 FORD MOTTOR CRED 7,3500% 01/07/29 H44A 830,061 0.05 USD 800,000 FORD MOTTOR CRED 7,3500% 01/07/29 H44A 830,061 0.05 USD 800,000 FORD MOTTOR CRED 7,3500% 01/07/29 H44A 830,061 0.05						
USD 95,000 FORESTAR CROU 5,0000% 01/03/28 144A 888, 236 0.05 USD 850,000 DREAM FINDERS S, 2500% 15/01/29 144A 889, 236 0.05 USD 950,000 HANE STREET G 4.5000% 15/01/29 144A 879, 407 0.05 USD 1,925,000 HAVESBRANDS 19,0000% 15/07/29 144A 866, 250 0.05 USD 1,025,000 GAP INFORMATION 144A 866, 250 0.05 USD 1,025,000 GAP INFORMATION 144A 866, 243 0.05 USD 1,005,000 GAP INFORMATION 144A 866, 243 0.05 USD 825,000 GENESIS ENERGY 8, 8750% 15/07/29 144A 883, 741 0.05 USD 825,000 GENESIS ENERGY 8, 8750% 15/07/29 144A 883, 242 0.05 USD 825,000 GENESIS ENERGY 8, 8750% 15/07/21 44A 881, 848 0.06 USD 825,000 USD 144A 881, 15/02/21 44A 881, 188 0.06 USD 825,000 USD 144A 881, 15/02/21 44A 881, 188 0.06 USD 825,000 USD 144A 884, 15/02/21 44A 884, 128 0.05 USD 1,000,000 MICHAELS COS 5, 2500% 01/05/28 144A 884, 128 0.05 USD 835,000 USD 14/02/21 44A 884, 128 0.05 USD 835,000 USD 14/02/21 44A 884, 128 0.05 USD 835,000 USD 14/02/21 484 884, 187, 187, 187, 187, 187, 187, 187, 187						
USD						
USD						
USD						
USD 1, 925, 000						
USD 1,025,000 GAP INC/THE 3,8750% 01/10/31 144A 866, 243 0.05 USD 1,100,000 SUNOVA ENERG 5,8750% 01/09/26 144A 865, 741 0.05 USD 825,000 GENESIS ENERGY 8,8750% 15/04/30 863, 292 0.05 USD 900,000 CATALENT PHAR 3,1250% 15/02/29 144A 861,818 0.05 USD 800,000 CREDIT ACCEPTANC 9,2500% 15/12/28 860,966 0.05 USD 825,000 SUMIT MATERI 7,2500% 15/01/31 144A 858,139 0.05 USD 1,000,000 MICHAELS COS 5,2500% 01/05/28 144A 845,128 0.05 USD 775,000 CARIVAL HLD 10,3750% 01/05/28 144A 844,642 0.05 USD 835,000 USP CARIVAL HLD 10,3750% 01/05/28 144A 844,642 0.05 USD 835,000 CALLON PETROLEU 6,3750% 01/05/28 144A 844,642 0.05 USD 850,000 SYNCHRONY FINANC 7,2500% 02/02/33 843,737 0.05 USD 850,000 SYNCHRONY FINANC 7,2500% 02/02/33 844,737 0.05 USD 950,000 TOPPULLD CORP 4, 1250% 15/02/32 144A 840,767 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7,3500% 02/02/33 844,737 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7,3500% 02/02/34 844,0767 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7,3500% 02/02/34 144A 886,403 0.05 USD 800,000 CHAMPIONS FIN 8,7500% 15/02/29 144A 886,676 0.05 USD 800,000 CHAMPIONS FIN 8,7500% 15/02/29 144A 886,603 0.05 USD 800,000 BORR IHC/BOR 10,3750% 15/02/29 144A 836,603 0.05 USD 800,000 BORR IHC/BOR 10,3750% 15/02/29 144A 830,061 0.05 USD 800,000 BORR IER/BOR 10,3750% 15/10/29 144A 830,061 0.05 USD 800,000 BOR 18/C/BOR 10,3750% 15/10/29 144A 830,061 0.05 USD 800,000 ATTINC 7,2500% 10/02/32 144A 830,061 0.05 USD 800,000 ATTINC 7,2500% 15/02/29 144A 830,061 0.05 USD 800,000 FORD MONAPAC REERE 8,0000% 01/04/29 144A 830,061 0.05 USD 800,000 FORD MONAPAC REERE 8,0000% 01/04/29 144A 830,061 0.05 USD 800,000 ATTINC 7,2500% 15/02/29 144A 829,769 0.05 USD 800,000 FORD MONAPAC REERE 8,0000% 01/04/29 144A 830,061 0.05 USD 800,000 FORD MONAPAC REERE 8,0000% 01/04/29 144A 830,061 0.05 USD 800,000 FORD MONAPAC REERE 8,0000% 01/04/29 144A 830,061 0.05 USD 800,000 FORD MONAPAC REERE 8,0000% 01/04/29 144A 830,061 0.05 USD 800,000 FORD MONAPAC REERE 8,0000% 01/04/29 144A 830,061 0.05 USD 800,000 FORD MONAPAC REERE 8,00000% 01/04/29 144A 830,061 0.05 USD 800,000 FORD						
USD	USD	1, 925, 000	LEVEL 3 FIN I 3.7500% 15/07/29 144A	866, 250	0.05	
USD 90,000 CENESIS ENERGY 8, 8750% 15/04/30 862, 292 0.05 USD 900,000 CATALENT PHAR 3, 1250% 15/02/29 144A 861, 818 0.05 USD 800,000 CREDIT ACCEPTANC 9, 2500% 16/12/28 860, 966 0.05 USD 825,000 SUMIT MATERI 7, 2500% 15/01/31 144A 856, 139 0.05 USD 1,000,000 MICHAELS COS 5, 2500% 01/05/28 144A 845, 128 0.05 USD 775,000 CARNIVAL HID 10, 3750% 01/05/28 144A 844, 642 0.05 USD 835,000 US CALLON PETROLEU 6, 3750% 01/07/26 WI 843, 876 0.05 USD 835,000 US PODEN INC 6, 8750% 15/09/28 144A 843, 799 0.05 USD 850,000 SYNCHRONY FINANC 7, 2500% 02/02/33 843, 737 0.05 USD 850,000 SYNCHRONY FINANC 7, 2500% 02/02/33 843, 737 0.05 USD 850,000 FORD MOTOR CRED 7, 3500% 02/02/33 843, 737 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7, 3500% 02/02/34 144A 840, 767 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7, 3500% 04/11/27 839,908 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7, 3500% 04/11/27 839,908 0.05 USD 800,000 CHAMPIONS FIN 8, 7500% 15/02/29 144A 836, 676 0.05 USD 800,000 CHAMPIONS FIN 8, 7500% 15/02/29 144A 836, 676 0.05 USD 800,000 BORR IHC/BOR 10, 3750% 15/02/29 144A 836, 603 0.05 USD 800,000 BORR IHC/BOR 10, 3750% 15/10/29 144A 832, 000 0.05 USD 800,000 BORR IHC/BOR 10, 3750% 15/10/29 144A 832, 000 0.05 USD 800,000 BOR IHC/BOR 10, 3750% 15/10/29 144A 832, 000 0.05 USD 800,000 BOR IHC/BOR 10, 3750% 15/10/29 144A 822, 789 0.05 USD 800,000 ATTIN INC 7, 2500% 15/06/25 144A 822, 789 0.05 USD 800,000 ATTIN INC 7, 2500% 15/06/25 144A 822, 789 0.05 USD 800,000 ATTIN INC 7, 2500% 15/00/29 144A 822, 789 0.05 USD 800,000 ATTIN INC 7, 2500% 15/00/29 144A 822, 789 0.05 USD 800,000 ATTIN INC 7, 2500% 15/00/29 144A 822, 789 0.05 USD 800,000 ATTIN INC 7, 2500% 15/00/29 144A 822, 789 0.05 USD 800,000 AND ARCERE S 0000% 15/00/29 144A 822, 789 0.05 USD 800,000 WULLAMS SCOT 6, 1250% 15/00/29 144A 822, 789 0.05 USD 800,000 ATTIN INC 7, 2500% 15/00/29 144A 822, 789 0.05 USD 800,000 ATTIN INC 7, 2500% 15/00/29 144A 822, 789 0.05 USD 800,000 ATTIN INC 7, 2500% 15/00/29 144A 822, 789 0.05 USD 800,000 ATTIN INC 7, 2500% 15/00/29 144A 800, 733 0.05 USD 800,000 ATTIN INC 7, 2500% 1	USD	1, 025, 000	GAP INC/THE 3.8750% 01/10/31 144A	866, 243	0.05	
USD 800,000 CATALENT PHAR 3.1250% 15/02/29 144A 861,818 0.05 USD 800,000 CREDIT ACCEPTANC 9.2500% 15/01/31 144A 886,966 0.05 USD 1,000,000 MICHAELS COS 5.2500% 01/05/28 144A 845,128 0.05 USD 775,000 CARNIVAL HLD 10.3750% 01/05/28 144A 845,128 0.05 USD 835,000 CALLON PETROLEU 6.3750% 01/05/28 144A 844,642 0.05 USD 835,000 US POODS INC 6.8750% 01/05/28 144A 843,799 0.05 USD 850,000 US POODS INC 6.8750% 01/05/28 144A 843,799 0.05 USD 850,000 US POODS INC 6.8750% 01/05/28 144A 843,797 0.05 USD 850,000 TOPBUILD CORP 4.1250% 15/02/23 144A 840,767 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7.3500% 02/02/33 843,737 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7.3500% 02/02/34 144A 840,767 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7.3500% 02/02/34 144A 836,676 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7.3500% 02/02/34 144A 836,676 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7.3500% 02/02/34 144A 836,676 0.05 USD 800,000 EPAC MONOR IN 8.7500% 15/02/29 144A 836,676 0.05 USD 800,000 BORR HIC/ROR 10.3750% 15/02/29 144A 836,603 0.05 USD 800,000 BOR HIC/ROR 10.3750% 15/02/29 144A 836,603 0.05 USD 800,000 BOR HIC/ROR 10.3750% 15/11/30 144A 832,000 0.05 USD 825,000 EQM MIDSTREAM 6.3750% 01/02/29 144A 832,000 0.05 USD 825,000 BONANZA CREEK 5.0000% 15/10/26 144A 829,799 0.05 USD 800,000 AT INC 7.2500% 15/02/29 144A 829,799 0.05 USD 800,000 AT INC 7.2500% 15/02/29 144A 829,799 0.05 USD 800,000 AT INC 7.2500% 15/02/29 144A 829,799 0.05 USD 800,000 AT INC 7.2500% 15/02/29 144A 829,799 0.05 USD 800,000 AT INC 7.2500% 15/02/29 144A 829,799 0.05 USD 800,000 BONANZA CREEK 5.0000% 15/10/26 144A 829,799 0.05 USD 800,000 AT INC 7.2500% 15/02/30 144A 829,799 0.05 USD 800,000 AT INC 7.2500% 15/02/31 144A 829,800 0.05 USD 800,000 AND STANDARD NO STAND	USD	1, 100, 000	SUNNOVA ENERG 5.8750% 01/09/26 144A	863, 741	0.05	
USD 800,000 CATALENT PHAR 3.1250% 15/02/29 144A 861,818 0.05 USD 800,000 CREDIT ACCEPTANC 9.2500% 15/01/31 144A 886,966 0.05 USD 1,000,000 MICHAELS COS 5.2500% 01/05/28 144A 845,128 0.05 USD 775,000 CARNIVAL HLD 10.3750% 01/05/28 144A 845,128 0.05 USD 835,000 CALLON PETROLEU 6.3750% 01/05/28 144A 844,642 0.05 USD 835,000 US POODS INC 6.8750% 01/05/28 144A 843,799 0.05 USD 850,000 US POODS INC 6.8750% 01/05/28 144A 843,799 0.05 USD 850,000 US POODS INC 6.8750% 01/05/28 144A 843,797 0.05 USD 850,000 TOPBUILD CORP 4.1250% 15/02/23 144A 840,767 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7.3500% 02/02/33 843,737 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7.3500% 02/02/34 144A 840,767 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7.3500% 02/02/34 144A 836,676 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7.3500% 02/02/34 144A 836,676 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7.3500% 02/02/34 144A 836,676 0.05 USD 800,000 EPAC MONOR IN 8.7500% 15/02/29 144A 836,676 0.05 USD 800,000 BORR HIC/ROR 10.3750% 15/02/29 144A 836,603 0.05 USD 800,000 BOR HIC/ROR 10.3750% 15/02/29 144A 836,603 0.05 USD 800,000 BOR HIC/ROR 10.3750% 15/11/30 144A 832,000 0.05 USD 825,000 EQM MIDSTREAM 6.3750% 01/02/29 144A 832,000 0.05 USD 825,000 BONANZA CREEK 5.0000% 15/10/26 144A 829,799 0.05 USD 800,000 AT INC 7.2500% 15/02/29 144A 829,799 0.05 USD 800,000 AT INC 7.2500% 15/02/29 144A 829,799 0.05 USD 800,000 AT INC 7.2500% 15/02/29 144A 829,799 0.05 USD 800,000 AT INC 7.2500% 15/02/29 144A 829,799 0.05 USD 800,000 AT INC 7.2500% 15/02/29 144A 829,799 0.05 USD 800,000 BONANZA CREEK 5.0000% 15/10/26 144A 829,799 0.05 USD 800,000 AT INC 7.2500% 15/02/30 144A 829,799 0.05 USD 800,000 AT INC 7.2500% 15/02/31 144A 829,800 0.05 USD 800,000 AND STANDARD NO STAND	USD	825,000	GENESIS ENERGY 8.8750% 15/04/30	863, 292	0.05	
USD 825, 000 SUMMT MATERI 7, 2500% 15/12/28 880, 966 0.05 USD 1,000,000 MICHAELS COS 5, 2500% 15/05/28 144A 885, 139 0.05 USD 775, 000 CARNIVAL HLD 10, 3750% 01/05/28 144A 844, 642 0.05 USD 825, 000 USD 765, 000 CALLON PETROLEU 6, 3750% 01/07/26 WI 843, 876 0.05 USD 825, 000 US FOODS 105, 68, 8750% 15/09/28 144A 843, 876 0.05 USD 825, 000 US FOODS 105, 68, 8750% 15/09/28 144A 843, 799 0.05 USD 850, 000 SYNCHRONY FINANC 7, 2500% 02/02/33 843, 737 0.05 USD 950, 000 TOPBUILD CORP 4, 1250% 15/09/28 144A 840, 767 0.05 USD 850, 000 FORD MOTOR CRED 7, 3500% 04/11/27 839, 908 0.05 USD 825, 000 BEACON ROOFIN 6, 5000% 01/08/30 144A 836, 676 0.05 USD 825, 000 CHAMPIONS FIN 8, 7500% 15/02/29 144A 836, 676 0.05 USD 825, 000 BEACON ROOFIN 6, 5000% 15/07/28 144A 835, 838 0.05 USD 875, 000 IRON MOUNTAIN 5, 0000% 15/07/28 144A 835, 838 0.05 USD 875, 000 BORN HIC/BOR 10, 3750% 15/07/29 144A 835, 838 0.05 USD 825, 000 BORN HIC/BOR 10, 3750% 15/07/29 144A 830, 061 0.05 USD 825, 000 HOWARD HUGHES 4, 1250% 01/02/29 144A 830, 061 0.05 USD 825, 000 HOWARD HUGHES 4, 1250% 01/02/29 144A 830, 061 0.05 USD 825, 000 BORN ELERA 6, 3750% 01/04/29 144A 830, 061 0.05 USD 825, 000 HOWARD HUGHES 4, 1250% 01/02/29 144A 830, 061 0.05 USD 800, 000 ATI INC 7, 2500% 15/08/30 877, 447 0.05 USD 800, 000 ATI INC 7, 2500% 15/08/30 877, 447 0.05 USD 800, 000 ATI INC 7, 2500% 15/08/30 877, 447 0.05 USD 800, 000 WULLIAMS SCOT 6, 1250% 01/02/29 144A 825, 958 0.05 USD 800, 000 FINCETY FINAN 8, 8750% 10/02/29 144A 825, 958 0.05 USD 800, 000 FINCETY FINAN 8, 8750% 10/02/29 144A 825, 958 0.05 USD 800, 000 FINCETY FINAN 8, 8750% 10/02/29 144A 825, 958 0.05 USD 800, 000 FINCETY FINAN 8, 8750% 10/02/32 833, 588 0.05 USD 800, 000 FINCETY FINAN 8, 8750% 10/02/32 833, 588 0.05 USD 800, 000 FINCETY FINAN 8, 8750% 10/02/32 144A 80, 80, 853 0.05 USD 800, 000 FINCETY FINAN 8, 8750% 10/02/32 144A 80, 80, 863 0.05 USD 800, 000 FINCETY FINAN 8, 8750% 10/02/32 144A 80, 80, 863 0.05 USD 800, 000 FINCETY FINAN 8, 8750% 10/02/32 144A 80, 80, 863 0.05 USD 800, 000 FINCETY FINAN 8					0.05	
USD 1,000,000 MICHAELS COS 5,2500% 01/05/28 144A 845,128 0.05 USD 775,000 CARNIVAL HLD 10,3750% 01/05/28 144A 844, 642 0.05 USD 835,000 CARNIVAL HLD 10,3750% 01/05/28 144A 844, 642 0.05 USD 835,000 US FOODS INC 6,8750% 15/06/28 144A 843, 799 0.05 USD 850,000 SYNCHRONY FINANC 7,2500% 02/02/33 843,737 0.05 USD 850,000 SYNCHRONY FINANC 7,2500% 02/02/33 843,737 0.05 USD 850,000 TOPBUILD CORP 4,1250% 15/06/22 144A 840,767 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7,3500% 02/02/32 144A 840,767 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7,3500% 02/02/32 144A 840,767 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7,3500% 02/02/32 144A 836,676 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7,3500% 04/10/37 144A 836,676 0.05 USD 800,000 CHAMPIONS FIN 8,7500% 15/07/28 144A 836,673 0.05 USD 800,000 BEACON ROOFIN 6,5000% 15/07/28 144A 835,838 0.05 USD 800,000 BORR HHC/BOR 10,3750% 15/11/30 144A 835,838 0.05 USD 825,000 EQM MIDSTREAM 6,3750% 01/04/29 144A 830,061 0.05 USD 825,000 EQM MIDSTREAM 6,3750% 01/04/29 144A 830,061 0.05 USD 825,000 HOWARD HUGHES 4,1250% 01/02/29 144A 829,769 0.05 USD 800,000 ATI INC 7,2500% 15/06/25 144A 829,769 0.05 USD 800,000 ATI INC 7,2500% 15/08/30 827,447 0.05 USD 800,000 ATI INC 7,2500% 15/08/30 827,447 0.05 USD 800,000 ENOREC EXTENS 8,0000% 15/06/25 144A 825,988 0.05 USD 800,000 ENORE CAPITA 9,2500% 01/02/30 144A 825,988 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/02/30 144A 825,789 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/02/30 144A 821,867 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/02/30 144A 800,593 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/02/30 144A 800,593 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/02/30 144A 800,593 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/02/30 144A 800,593 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/02/30 144A 800,593 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/02/30 144A 800,599 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/02/30 144A 800,599 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/02/30 144A 800,599 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/02/30 144A 800,599 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/02/30 144A 800,599						
USD 1,000,000 MICHAELS COS 5,2500% 01/05/28 144A 844,622 0.05 USD 775,000 CARNIVAL H.D. 10,3750% 01/05/28 144A 844,622 0.05 USD 835,000 US POODS IN C, 85750% 15/09/28 144A 843,876 0.05 USD 852,000 US POODS IN C, 85750% 15/09/28 144A 843,799 0.05 USD 850,000 SYNCHROMY FINANC 7,2500% 02/02/33 843,737 0.05 USD 950,000 TOPBUILD CORP 4, 1250% 15/02/23 144A 840,767 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7,3500% 04/11/27 839,908 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7,3500% 04/11/27 839,908 0.05 USD 800,000 CHAMPIONS FIN 8,7500% 04/11/27 839,908 0.05 USD 800,000 CHAMPIONS FIN 8,7500% 15/02/29 144A 836,403 0.05 USD 875,000 BEACON ROOFIN 6,5000% 15/02/29 144A 836,403 0.05 USD 800,000 BORN HIC/BOR 10,3750% 15/11/30 144A 832,000 0.05 USD 800,000 BORN HIC/BOR 10,3750% 15/11/30 144A 832,000 0.05 USD 825,000 HOWARD HUGHES 4,1250% 01/02/29 144A 829,999 0.05 USD 925,000 HOWARD HUGHES 4,1250% 01/02/29 144A 829,999 0.05 USD 800,000 BONANZA CREEK 5,0000% 15/10/26 144A 829,769 0.05 USD 800,000 WILLIAMS SCOT 6,1250% 15/02/29 144A 829,769 0.05 USD 800,000 WILLIAMS SCOT 6,1250% 15/02/21 44A 825,598 0.05 USD 800,000 WILLIAMS SCOT 6,1250% 15/02/21 44A 825,598 0.05 USD 800,000 APO INCT 1,250% 01/02/21 44A 825,598 0.05 USD 800,000 WILLIAMS SCOT 6,1250% 15/02/21 44A 825,598 0.05 USD 800,000 APO INCT 1,250% 01/02/21 44A 821,867 0.05 USD 800,000 APO INCT 1,250% 01/02/21 44A 821,867 0.05 USD 800,000 QVC INC 4,3750% 01/02/32 144A 821,867 0.05 USD 800,000 QVC INC 4,3750% 01/02/32 144A 803,173 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6,7500% 15/03/29 144A 803,173 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6,7500% 15/03/29 144A 803,173 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6,7500% 15/03/29 144A 803,173 0.05 USD 800,000 WILLIAMS SCOT 6,1250% 01/03/29 144A 803,173 0.05 USD 800,000 WILLIAMS SCOT 6,1250% 01/03/29 144A 803,173 0.05 USD 800,000 SENDER FOR TOO TOO TOO TOO TOO TOO TOO TOO TOO T						
USD						
USD 835,000 CALLON PETROLEU 6,3750% 01/07/26 WI 843,876 0.05 USD 825,000 US FOODS INC 6,8750% 15/09/28 144A 843,799 0.05 USD 850,000 SYNCHRONY FINANC 7, 2500% 02/02/33 843,737 0.05 USD 950,000 TOPBUILD CORP 4,1250% 15/02/29 144A 840,767 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7, 3500% 04/11/27 839,908 0.05 USD 825,000 BEACON ROOFIN 6,5000% 01/08/30 144A 836,676 0.05 USD 800,000 CHAMFIONS FIN 8,7500% 15/02/29 144A 836,403 0.05 USD 875,000 IRON MOUNTAIN 5,0000% 15/02/29 144A 836,403 0.05 USD 800,000 EOR HIC-VBOR 10,37500% 15/02/29 144A 832,000 0.05 USD 800,000 BORR HIC-VBOR 10,3750% 15/11/30 144A 832,000 0.05 USD 825,000 EQM MIDSTREAM 6,3750% 01/04/29 144A 832,000 0.05 USD 925,000 HOWARD HUGHES 4,1250% 01/02/29 144A 829,799 0.05 USD 800,000 AT INC 7, 2500% 15/06/25 144A 829,769 0.05 USD 800,000 AT INC 7, 2500% 15/06/25 144A 829,769 0.05 USD 800,000 AT INC 7, 2500% 15/06/25 144A 829,769 0.05 USD 800,000 WILLIAMS SCOT 6, 1250% 15/02/29 144A 825,598 0.05 USD 800,000 AND FOINC 7, 1250% 01/02/23 823,558 0.05 USD 800,000 FOR INC 7, 1500% 15/06/25 144A 825,598 0.05 USD 800,000 AND FOINC 7, 1250% 01/02/23 823,558 0.05 USD 800,000 WILLIAMS SCOT 6, 1250% 01/02/39 144A 821,867 0.05 USD 800,000 APO INFECTV FINAN 8, 8750% 01/02/39 144A 821,867 0.05 USD 800,000 ARE SCROPE AS 8600% 01/04/29 144A 821,867 0.05 USD 800,000 ARE SCROPE AS 8600% 01/04/29 144A 821,867 0.05 USD 900,000 QUC INC 4, 3750% 01/09/28 817,446 0.05 USD 800,000 ARE SCROPW 6, 7500% 15/03/29 144A 808,8173 0.05 USD 800,000 ARE SCROPW 6, 15/03/29 144A 808,8173 0.05 USD 800,000 ARE SCROPW 6, 15/00/29 144A 808,881,73 0.05 USD 800,000 ARE SCROPW 6, 15/00/29 144A 808,881,73 0.05 USD 800,000 ARE SCROPW 6, 15/00/29 144A 808,881,73 0.05 USD 800,000 ARE SCROPW 6, 15/00/29 144A 808,881,73 0.05 USD 800,000 ARE SCROPW 6, 15/00/29 144A 808,881,73 0.05 USD 800,000 ARE SCROPW 6, 15/00/29 144A 808,881,73 0.05 USD 800,000 BUILDENS 6, 25000% 15/00/29 144A 809,883 0.05 USD 800,000 WILLIAMS 6, 25000% 15/00/29 144A 809,883 0.05 USD 800,000 WILLIAMS 6, 25000% 15/00/29 144A 809,883 0.05 USD 80						
USD 850,000 US FOODS INC 6,8750% 15/09/28 144A 843,799 0.05 USD 850,000 SYNCHRONY FINANC 7,2500% 02/02/33 843,737 0.05 USD 950,000 FORD MOTOR CRED 7,3500% 04/11/27 839,908 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7,3500% 04/11/27 839,908 0.05 USD 825,000 BEACON ROOFIN 6,5000% 01/08/30 144A 836,676 0.05 USD 875,000 BEACON ROOFIN 6,5000% 01/08/30 144A 836,403 0.05 USD 875,000 BEACON ROOFIN 6,5000% 01/08/30 144A 836,403 0.05 USD 875,000 BORN HOLVITAIN 5,0000% 15/02/29 144A 835,838 0.05 USD 825,000 EQM MIDSTREAM 6,3750% 15/11/30 144A 832,000 0.05 USD 825,000 EQM MIDSTREAM 6,3750% 01/02/29 144A 830,061 0.05 USD 825,000 HOWARD HUGHES 4,1250% 01/02/29 144A 829,799 0.05 USD 850,000 BONANZA CREEK 5,0000% 15/07/26 144A 829,799 0.05 USD 850,000 BONANZA CREEK 5,0000% 15/07/26 144A 829,799 0.05 USD 800,000 ATI INC 7,2500% 15/08/30 827,447 0.05 USD 829,000 WILLIAMS SCOT 6,1250% 15/08/25 144A 825,958 0.05 USD 829,000 WILLIAMS SCOT 6,1250% 15/08/25 144A 825,958 0.05 USD 825,000 DIRECTY FINAN 8,8750% 01/02/30 44A 822,729 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/02/30 144A 822,729 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/02/30 144A 822,729 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/02/30 144A 821,867 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/02/30 144A 821,867 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/02/30 144A 821,867 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/02/30 144A 809,583 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6,7500% 15/02/28 817,446 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/03/29 144A 800,503 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6,7500% 15/02/20 144A 800,503 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6,7500% 15/02/22 144A 806,966 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6,7500% 15/02/22 144A 806,966 0.05 USD 800,000 ANTIONSTAR MT 7,1250% 01/02/21 144A 800,529 0.05 USD 800,000 ANTIONSTAR MT 7,1250% 01/02/21 144A 792,578 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/02/21 144A 792,578 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/03/29 144A 792,578 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/03/29 144A 800,529 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9,2500% 01/03/29 144A 800,529 0.05 USD 800,0						
USD 850,000 SYNCHRONY FINANC 7, 2500% 02/02/33 843, 737 0.05 USD 950,000 TOPBUILD CORP 4, 1250% 15/02/32 144A 840, 767 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7, 3500% 04/11/27 839,908 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7, 3500% 04/11/27 839,908 0.05 USD 800,000 CHAMPIONS FIN 8, 7500% 16/02/29 144A 836, 676 0.05 USD 800,000 CHAMPIONS FIN 8, 7500% 15/02/29 144A 836, 403 0.05 USD 800,000 BORR IHC/BOR 10, 3750% 15/10/130 144A 832, 000 0.05 USD 800,000 BORR IHC/BOR 10, 3750% 15/10/130 144A 832, 000 0.05 USD 825,000 EQM MIDSTREAM 6, 3750% 01/04/29 144A 830, 061 0.05 USD 925,000 HOWARD HUGHES 4, 1250% 01/02/29 144A 829, 769 0.05 USD 800,000 BONANZA CREEK 5, 0000% 15/10/26 144A 829, 769 0.05 USD 800,000 ATI INC 7, 2500% 15/08/30 827, 447 0.05 USD 800,000 WILLIAMS SCOT 6, 1250% 15/06/25 144A 829, 769 0.05 USD 800,000 WILLIAMS SCOT 6, 1250% 15/06/25 144A 825, 958 0.05 USD 800,000 DIRECTV FINAN 8, 8750% 01/02/32 823, 588 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9, 2500% 10/02/30 144A 821, 867 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9, 2500% 01/04/29 144A 821, 867 0.05 USD 800,000 QVC INC 4, 3750% 01/09/28 144A 821, 867 0.05 USD 800,000 QVC INC 4, 3750% 01/09/28 144A 809, 583 0.05 USD 800,000 ARE ESCROW 6, 7500% 15/09/28 144A 809, 583 0.05 USD 800,000 FINECTV FINAN 8, 8750% 01/09/29 144A 808, 173 0.05 USD 800,000 FINECTV FINAN 8, 8750% 01/09/29 144A 808, 173 0.05 USD 800,000 ARE ESCROW 6, 75000% 15/09/29 144A 808, 173 0.05 USD 800,000 FINECTV FINAN 8, 8750% 01/09/29 144A 809, 583 0.05 USD 800,000 FINECTV FINAN 8, 8750% 01/09/29 144A 809, 583 0.05 USD 800,000 FINECTV FINAN 8, 8750% 01/09/29 144A 809, 583 0.05 USD 800,000 FINECTV FINAN 8, 8750% 01/09/29 144A 809, 583 0.05 USD 800,000 FINECTV FINAN 8, 8750% 01/09/29 144A 809, 583 0.05 USD 800,000 FINECTV FINAN 8, 8750% 01/09/29 144A 809, 583 0.05 USD 800,000 FINECTV FINAN 8, 8750% 01/09/29 144A 809, 583 0.05 USD 800,000 FINECTV FINAN 8, 8750% 01/09/29 144A 809, 583 0.05 USD 800,000 FINECTV FINAN 8, 8750% 01/09/29 144A 809, 583 0.05 USD 800,000 FINECTV FINAN 8, 8750% 01/09/29 144A 809, 583 0.05 USD 800,						
USD 950,000 TOPBUILD CORP 4.1250% 15/02/32 144A 840,767 0.05 USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7.3500% 04/11/27 839,908 0.05 USD 825,000 BEACON ROOFIN 6.5000% 01/08/30 144A 836,676 0.05 USD 800,000 CHAMPIONS FIN 8.7500% 15/02/29 144A 836,676 0.05 USD 875,000 IRON MOUNTAIN 5.0000% 15/02/29 144A 835,838 0.05 USD 825,000 BORR IHC/BOR 10.3750% 15/01/28 144A 832,000 0.55 USD 825,000 EQM MIDSTREAM 6.3750% 01/04/29 144A 830,061 0.05 USD 825,000 HOWARD HUGHES 4.1250% 01/02/29 144A 829,799 0.05 USD 850,000 BORN 17.2 CREEK 5.0000% 15/01/26 144A 829,799 0.05 USD 850,000 BONANZA CREEK 5.0000% 15/01/26 144A 829,799 0.05 USD 800,000 ATI INC 7.2500% 15/08/30 827,447 0.05 USD 829,000 WILLIAMS SCOT 6.1250% 15/08/30 827,447 0.05 USD 829,000 WILLIAMS SCOT 6.1250% 15/08/31 827,447 0.05 USD 820,000 DIRECTY FINAN 8.8750% 01/02/32 833,588 0.05 USD 825,000 DIRECTY FINAN 8.8750% 01/02/30 144A 822,729 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9.2500% 01/04/29 144A 822, 729 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9.2500% 01/04/29 144A 821,867 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9.2500% 01/04/29 144A 821,867 0.05 USD 800,000 QUICKEN LOANS 3.6250% 61/03/29 144A 821,867 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6.7500% 15/03/29 144A 809,583 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6.7500% 15/03/29 144A 809,583 0.05 USD 800,000 FOST HOLDINGS 6.2500% 15/02/32 144A 806,966 0.05 USD 825,000 WICL PROPERTI 3.5000% 15/02/22 144A 806,966 0.05 USD 825,000 WICL PROPERTI 3.5000% 15/02/23 144A 806,966 0.05 USD 825,000 NATIONSTAR MT 7.1250% 01/02/21 144A 805,034 0.05 USD 800,000 CSC HOLDINGS 6.2500% 15/02/24 144A 805,034 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7.1250% 01/02/21 144A 792,880 0.05 USD 800,000 WATHORSTAR MT 7.1250% 01/02/21 144A 792,880 0.05 USD 800,000 WATHORSTAR MT 7.1250% 01/02/21 144A 792,578 0.05 USD 800,000 WATHORSTAR MT 7.1250% 01/02/21 144A 792,880 0.05 USD 800,000 WATHORSTAR MT 6.0000% 15/02/23 144A 792,880 0.05 USD 800,000 WATHORSTAR MT 6.0000% 15/02/29 144A 792,880 0.05 USD 755,000 WATHORSTAR MT 6.0000% 15/02/29 144A 792,578 0.05 USD 755,000 WATHORSTAR MT 6.0000% 15/02/29 144A 792,578 0.05 USD 7						
USD 800,000 FORD MOTOR CRED 7, 3500% 04/11/27 839,908 0.05 USD 825,000 BEACON ROOFIN 6, 5000% 01/08/30 144A 836,676 0.05 USD 800,000 CHAMPIONS FIN 8.7500% 15/02/29 144A 836,6403 0.05 USD 800,000 BORR IHC/BOR 10, 3750% 15/11/30 144A 836,403 0.05 USD 800,000 BORR IHC/BOR 10, 3750% 15/11/30 144A 832,000 0.05 USD 825,000 EQM MIDSTREAM 6, 3750% 01/04/29 144A 830,061 0.05 USD 925,000 HOWARD HUGHES 4, 1250% 01/02/29 144A 829,799 0.05 USD 800,000 BONANZA CREEK 5,0000% 15/10/26 144A 829,799 0.05 USD 800,000 ATI INC 7, 2500% 15/08/30 827,447 0.05 USD 800,000 ATI INC 7, 2500% 15/08/30 827,447 0.05 USD 800,000 WILLIAMS SCOT 6, 1250% 15/06/25 144A 825,958 0.05 USD 800,000 DIRECTV FINAN 8,8750% 01/02/30 144A 822,729 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9, 2500% 01/02/30 144A 821,867 0.05 USD 800,000 QVC INC 4, 3750% 01/09/28 817,446 0.05 USD 900,000 QUCKEN LOANS 3, 6250% 01/03/29 144A 809,583 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6, 7500% 15/02/25 144A 809,583 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6, 7500% 15/02/29 144A 809,583 0.05 USD 800,000 VICI PROPERTI 3, 5000% 15/02/25 144A 809,583 0.05 USD 800,000 VICI PROPERTI 3, 5000% 15/02/25 144A 806,966 0.05 USD 800,000 VOST HOLDINGS 6, 2500% 15/02/25 144A 806,966 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7, 1250% 01/02/31 144A 806,966 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7, 1250% 01/02/31 144A 806,966 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7, 1250% 01/02/31 144A 806,966 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 1, 1250% 01/02/31 144A 792,880 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7, 1250% 01/02/32 144A 792,880 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 1500% 15/02/25 144A 792,880 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 1500% 15/02/25 144A 792,880 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 1500% 15/02/25 144A 792,880 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 1500% 15/02/31 144A 787, 770 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 1500% 15/02/31 144A 787, 770 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 1500% 15/02/31 144A 772, 544 0.05 USD 750,000 MERTER SIRI 5, 2500% 15/04/31 144A 772, 544 0.05 USD 765,000 MERTER SIRI 5, 2500% 15/04/31 144A 772, 544 0.05 USD 775,000 MERTER SIRI S, 2500% 15/04/31 14						
USD 825,000 BEACON ROOFIN 6, 5000% 01/08/30 1444A 836, 676 0.05   USD 800,000 CHAMPIONS FIN 8, 7500% 15/02/29 144A 836, 403 0.05   USD 800,000 BORR IHC/BOR 10, 3750% 15/07/28 144A 835, 838 0.05   USD 825,000 BORR IHC/BOR 10, 3750% 15/11/30 144A 832, 000 0.05   USD 825,000 HOWARD HUGHES 4, 1250% 01/02/29 144A 829, 799 0.05   USD 850,000 BONANZA CREEK 5, 0000% 15/10/26 144A 829, 799 0.05   USD 850,000 AT1 INC 7, 2500% 15/08/30 827, 447 0.05   USD 800,000 AT1 INC 7, 2500% 15/08/30 827, 447 0.05   USD 800,000 XPO INC 7, 1250% 01/02/32   USD 800,000 ENCORE CAPITA 9, 2500% 01/04/29 144A 822, 759 0.05   USD 800,000 QUICKEN LOANS 3, 6250% 01/03/29 144A 822, 759 0.05   USD 800,000 QUICKEN LOANS 3, 6250% 01/03/29 144A 822, 759 0.05   USD 800,000 AR ESCROW 6, 7500% 15/08/25 144A 808, 95, 583 0.05   USD 800,000 AR ESCROW 6, 7500% 15/08/27 144A 808, 91, 533 0.05   USD 800,000 AR ESCROW 6, 7500% 15/08/29 144A 808, 173 0.05   USD 800,000 AR ESCROW 6, 7500% 15/08/29 144A 806, 906 0.05   USD 800,000 AR ESCROW 6, 7500% 15/08/27 144A 806, 906 0.05   USD 800,000 NATIONSTAR MT 7, 1250% 01/02/31 144A 806, 906 0.05   USD 800,000 NATIONSTAR MT 7, 1250% 01/02/31 144A 806, 906 0.05   USD 800,000 NATIONSTAR MT 7, 1250% 01/02/31 144A 803, 788 0.05   USD 800,000 NATIONSTAR MT 7, 1250% 01/02/31 144A 792, 343 0.05   USD 800,000 NATIONSTAR MT 7, 1250% 01/02/31 144A 792, 578 0.05   USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 0000% 15/02/25 144A 792, 578 0.05   USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 0000% 15/08/28 144A 792, 578 0.05   USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 0000% 15/08/28 144A 792, 578 0.05   USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 0000% 15/08/28 144A 792, 578 0.05   USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 0000% 15/08/29 144A 771, 750 0.05   USD 750,000 NAUENT CORP 6, 75% 25/06/25 781, 029 0.05   USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 0000% 15/08/29 144A 771, 750 0.05   USD 765,000 HELCOR PERGE 6, 2500% 15/04/31 144A 770, 693 0.05   USD 775,000 HELCOR PERGE 6, 2500% 15/04/31 1						
USD 800,000 CHAMPIONS FIN 8, 7500% 15/02/29 144A 836, 403 0.05 USD 875,000 IRON MOUNTAIN 5.0000% 15/07/28 144A 835,838 0.05 USD 800,000 BORR IHC/BOR 10, 3750% 15/11/30 144A 832,000 0.05 USD 825,000 EQM MIDSTREAM 6. 3750% 01/04/29 144A 830, 661 0.05 USD 925,000 HOWARD HUGHES 4. 1250% 01/02/29 144A 829, 799 0.05 USD 850,000 BONANZA CREEK 5.0000% 15/10/26 144A 829, 799 0.05 USD 800,000 ATI INC 7. 2500% 15/08/30 827, 447 0.05 USD 800,000 ATI INC 7. 2500% 15/08/30 827, 447 0.05 USD 829,000 WILLIAMS SCOT 6. 1250% 15/06/25 144A 825, 958 0.05 USD 800,000 XPO INC 7. 1250% 01/02/32 823, 588 0.05 USD 825,000 DIRECTY FINAN 8. 8756% 01/02/30 144A 822, 729 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9. 2500% 01/04/29 144A 821, 867 0.05 USD 800,000 QVC INC 4. 3750% 01/09/28 817, 446 0.05 USD 900,000 QVC INC 4. 3750% 01/09/29 144A 821, 867 0.05 USD 900,000 QVC INC 4. 3750% 01/09/29 144A 899, 583 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6. 7500% 15/03/29 144A 809, 583 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6. 7500% 15/03/29 144A 808, 173 0.05 USD 800,000 POST HOLDINGS 6. 2500% 15/03/29 144A 806, 906 0.05 USD 800,000 POST HOLDINGS 6. 2500% 15/02/32 144A 806, 906 0.05 USD 825, 000 STANDARD IND 5% 15/02/32 144A 805, 378 0.05 USD 825, 000 STANDARD IND 5% 15/02/32 144A 805, 378 0.05 USD 825, 000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 805, 378 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/32 144A 793, 943 0.05 USD 800,000 CSC HOLDINGS 11. 2500% 15/06/29 144A 792, 880 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/06/29 144A 792, 578 0.05 USD 800,000 SSR DISTRIBUT 4. 6250% 01/02/31 144A 792, 578 0.05 USD 800,000 SSR DISTRIBUT 4. 6250% 01/02/31 144A 792, 578 0.05 USD 800,000 SSR DISTRIBUT 4. 6250% 01/02/31 144A 792, 578 0.05 USD 800,000 CSC HOLDINGS 11. 2500% 15/06/29 144A 792, 578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/06/29 144A 792, 578 0.05 USD 800,000 SSR DISTRIBUT 4. 6250% 01/02/31 144A 792, 578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/06/29 144A 792, 578 0.05 USD 800,000 POST BISTRIBUT 4. 6250% 01/02/31 144A 793, 943 0.05 USD 800,000 POST BISTRIBUT 4. 6250% 01/02/31 144A						
USD 875,000 IRON MOUNTAIN 5. 0000% 15/07/28 144A 835,838 0. 0.5 USD 800,000 BORR HIC/BOR 10. 3750% 15/17/30 144A 832,000 0. 0.5 USD 825,000 EQM MIDSTREAM 6. 3750% 01/04/29 144A 830,061 0. 0.5 USD 850,000 BONANZA CREEK 5. 0000% 15/10/26 144A 829,769 0. 0.5 USD 850,000 ATI INC 7. 2500% 15/08/30 827,447 0. 0.5 USD 829,000 WILLJAMS SCOT 6. 1250% 15/10/26 144A 829,769 0. 0.5 USD 829,000 WILLJAMS SCOT 6. 1250% 15/08/25 144A 825,958 0. 0.5 USD 800,000 XPO INC 7. 1250% 01/02/32 823,588 0. 0.5 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9. 2500% 01/04/29 144A 821,867 0. 0.5 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9. 2500% 01/04/29 144A 821,867 0. 0.5 USD 800,000 QUICKEN LOANS 3. 6250% 01/03/29 144A 809,583 0. 0.5 USD 900,000 QUICKEN LOANS 3. 6250% 01/03/29 144A 808,173 0. 0.5 USD 800,000 AAR ESCROW 6. 7500% 15/03/29 144A 808,173 0. 0.5 USD 825,000 VIC 1. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 0.						
USD 800,000 BORR IHC/BOR 10,3750% 15/11/30 144A 832,000 0.05 USD 825,000 EQM MIDSTREAM 6,3750% 01/04/29 144A 830,061 0.05 USD 925,000 HOWARD HUGHES 4.1250% 01/02/29 144A 829,799 0.05 USD 850,000 BONANZA CREEK 5.0000% 15/10/26 144A 829,769 0.05 USD 800,000 ATI INC 7.2500% 15/08/30 827,447 0.05 USD 829,000 WILLIAMS SCOT 6,1250% 15/06/25 144A 825,958 0.05 USD 800,000 XPO INC 7.1250% 01/02/32 823,588 0.05 USD 825,000 DIRECTV FINAN 8.8750% 01/02/30 144A 822,729 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9.2500% 01/04/29 144A 821,867 0.05 USD 1,025,000 QVC INC 4.3750% 01/09/28 817,446 0.05 USD 900,000 QVC INC 4.3750% 01/09/28 817,446 0.05 USD 900,000 QUICKEN LOANS 3.6250% 01/03/29 144A 809,583 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6.7500% 15/03/29 144A 808,173 0.05 USD 825,000 VICI PROPERTI 3.5000% 15/02/25 144A 806,906 0.05 USD 800,000 POST HOLDINGS 6.2500% 15/02/32 144A 806,906 0.05 USD 825,000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 805,034 0.05 USD 825,000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 805,034 0.05 USD 825,000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 805,529 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/32 144A 793,943 0.05 USD 825,000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/32 144A 792,578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/32 144A 792,578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/02/28 144A 792,578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/02/29 144A 792,578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/02/29 144A 792,578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/03/29 144A 792,578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/03/29 144A 792,578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/03/29 144A 792,578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/03/29 144A 792,578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/03/29 144A 792,578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/03/29 144A 792,578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7.000% 15/03/29 144A 792,578 0.05 USD 750,000 MERITAGE HARCH A 600 0.05 USD 750,000 MERITAGE HARCH A 600 0.05 USD 765,000 MERITAGE HARCH A 600 0.05 USD 765,000 MERITAGE HA 600 0.05 15/03/29 144A 770,693 0.05 USD 765,000 MERITAGE HA 600 0.05 15/04/39						
USD 825,000 EQM MIDSTREAM 6, 3750% 01/04/29 144A 820, 061 0.05 USD 925,000 HOWARD HUGHES 4, 1250% 01/02/29 144A 829, 769 0.05 USD 850,000 BONANZA CREEK 5,000% 15/10/26 144A 829, 769 0.05 USD 800,000 ATI INC 7, 2500% 15/08/30 827, 447 0.05 USD 829,000 WILLIAMS SCOT 6, 1250% 15/06/25 144A 825, 958 0.05 USD 800,000 XPO INC 7, 1250% 01/02/32 823, 588 0.05 USD 825,000 DIRECTV FINAN 8, 8750% 01/02/30 144A 822, 729 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9, 25500% 01/04/29 144A 821, 867 0.05 USD 800,000 QVC INC 4, 3750% 01/09/28 817, 446 0.05 USD 900,000 QUICKEN LOANS 3, 6250% 01/03/29 144A 809, 583 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6, 7500% 15/03/29 144A 808, 173 0.05 USD 800,000 POST HOLDINGS 6, 2500% 15/02/23 144A 806, 906 0.05 USD 825,000 VICI PROPERTI 3, 5000% 15/02/25 144A 806, 906 0.05 USD 800,000 POST HOLDINGS 6, 2500% 15/02/23 144A 806, 906 0.05 USD 825,000 WICI PROPERTI 3, 5000% 15/02/23 144A 806, 906 0.05 USD 825,000 WICI PROPERTI 3, 5000% 15/02/23 144A 806, 906 0.05 USD 825,000 STANDARD IN 5% 15/02/27 144A 806, 529 0.05 USD 825,000 NATIONSTAR MT 7, 1250% 01/02/31 144A 793, 943 0.05 USD 800,000 ANTERO MIDSTR 5, 3750% 15/06/29 144A 793, 943 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7, 1250% 01/02/32 144A 787, 770 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 0000% 15/01/27 144A 787, 770 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 0000% 15/01/27 144A 785, 341 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 0000% 15/01/27 144A 785, 341 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 0000% 15/01/27 144A 785, 341 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 0000% 15/01/27 144A 785, 341 0.05 USD 800,000 WIVENT CORP 6, 75% 25/06/25 781, 029 USD 800,000 WIVENT CORP 6, 75% 25/06/25 781, 029 USD 800,000 WIVENT CORP 6, 75% 25/06/25 781, 029 USD 800,000 WIVENT CORP 6, 75% 25/06/25 781, 029 USD 800,000 WITAL ENERGY INC 9, 75000% 15/01/28 144A 770, 693 0.05 USD 705,000 WITAL ENERGY INC 9, 75000% 15/01/28 144A 770, 693 0.05 USD 765,000 WERTAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 0.05 USD 875,000 PRESTIGE BRAN 3, 7500% 01/04/31 144A 760, 502 0.05 USD 775,000 HULCORP ENERG 6, 25000% 15/04/32 144A 750, 501 0.05						
USD 925,000 HOWARD HUGHES 4. 1250% 01/02/29 144A 829,769 0. 0.5 USD 850,000 BONANZA CREEK 5. 0000% 15/10/26 144A 829,769 0. 0.5 USD 800,000 ATI INC 7. 2500% 15/08/30 827,447 0. 0.5 USD 829,000 WILLIAMS SCOT 6. 1250% 15/06/25 144A 825,968 0. 0.6 USD 800,000 XPO INC 7. 1250% 01/02/32 823,588 0. 0.5 USD 800,000 XPO INC 7. 1250% 01/02/32 823,588 0. 0.5 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9. 2500% 01/04/29 144A 822, 729 0. 0.5 USD 1, 025,000 QVC INC 4. 3750% 01/02/30 144A 821, 867 0. 0.5 USD 900,000 QUICKEN LOANS 3. 6250% 01/03/29 144A 809, 583 0. 0.5 USD 900,000 AR ESCROW 6. 7500% 15/03/29 144A 809, 583 0. 0.5 USD 800,000 AR ESCROW 6. 7500% 15/03/29 144A 806, 906 0. 0.5 USD 800,000 AR ESCROW 6. 7500% 15/02/25 144A 806, 906 0. 0.5 USD 800,000 HOWARD HUGHES 4. 3750% 01/02/31 144A 805, 034 0. 0.5 USD 925,000 HOWARD HUGHES 4. 3750% 01/02/31 144A 805, 034 0. 0.5 USD 925,000 HOWARD HUGHES 4. 3750% 01/02/31 144A 805, 334 0. 0.5 USD 825,000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 800, 529 0. 0.5 USD 825,000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/32 144A 793, 943 0. 0.5 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/31 144A 793, 943 0. 0.5 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/31 144A 792, 580 0. 0.5 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/06/29 144A 792, 580 0. 0.5 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/06/29 144A 785, 341 0. 0.5 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/06/29 144A 785, 341 0. 0.5 USD 800,000 NAVIENT CORP 6. 75% 25/06/25 781, 029 USD 800,000 WILLE CORP 6. 75% 25/06/25 781, 029 USD 775,000 NAVIENT CORP 6. 75% 25/06/25 781, 029 USD 800,000 USD SENSITHED T. 4. 82500% 01/07/28 144A 771, 750 0. 0.5 USD 800,000 WITAL ENERGY INC 9. 7500% 15/10/30 764, 833 0. 0.5 USD 800,000 WITAL ENERGY INC 9. 7500% 15/10/30 764, 833 0. 0.5 USD 775,000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 0. 0.5 USD 775,000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 0. 0.5 USD 775,000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 0. 0.5 USD 775,000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 0. 0.5 USD 775,000 HUCORP ENERG 6. 25000% 15/06/31 144A 759, 501 0. 0.5						
USD 850,000 BONANZA CREEK 5.000% 15/10/26 144A 829,769 0.05 USD 800,000 ATI NC 7.2500% 15/08/30 827,447 0.05 USD 829,000 WILLIAMS SCOT 6.1250% 15/06/25 144A 825,958 0.05 USD 800,000 XPO INC 7.1250% 01/02/32 823,588 0.05 USD 800,000 XPO INC 7.1250% 01/02/30 144A 822,729 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9.2500% 01/04/29 144A 821,867 0.05 USD 900,000 QVC INC 4.3750% 01/09/28 817,446 0.05 USD 900,000 QVICKEN LOANS 3.6250% 01/03/29 144A 809,583 0.05 USD 900,000 QVICKEN LOANS 3.6250% 01/03/29 144A 809,583 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6.7500% 15/03/29 144A 806,906 0.05 USD 825,000 VICI PROPERTI 3.5000% 15/02/25 144A 806,906 0.05 USD 800,000 POST HOLDINGS 6.2500% 15/02/23 144A 805,034 0.05 USD 925,000 HOWARD HUGHES 4.3750% 01/02/31 144A 803,788 0.05 USD 825,000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 800,529 0.05 USD 825,000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 800,529 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7.1250% 01/02/32 144A 793,943 0.05 USD 825,000 KINFER MICES 11.250% 11/02/32 144A 792,880 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/01/27 144A 792,880 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/01/27 144A 785,341 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/01/27 144A 785,341 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/01/27 144A 785,341 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/01/27 144A 785,341 0.05 USD 775,000 NAVIENT CORP 6.75% 25/06/25 781,029 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/01/27 144A 771,750 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/01/27 144A 771,750 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/01/27 144A 785,341 0.05 USD 775,000 NAVIENT CORP 6.75% 25/06/25 781,029 0.05 USD 800,000 SR DISTRIBUT 4.6250% 01/07/28 144A 771,750 0.05 USD 800,000 SR DISTRIBUT 5.000 11/07/28 144A 771,750 0.05 USD 775,000 HUCARD FIRS 5.0000% 15/01/27 144A 771,750 0.05 USD 775,000 FESTIGE BRAN 3.75000 11/07/28 144A 771,750 0.05 USD 775,000 FESTIGE BRAN 3.75000 11/07/28 144A 771,750 0.05 USD 775,000 HUCORP ENERG 6.2500% 15/01/20 144A 756,571 0.05 USD 775,000 HUCORP ENERG 6.2500% 15/04/32 144A 756,571 0.05						
USD 800,000 ATI INC 7. 2500% 15/08/30 827, 447 0. 05 USD 829,000 WILLIAMS SCOT 6. 1250% 15/06/25 144A 825, 958 0. 05 USD 800,000 XPO INC 7. 1250% 01/02/32 823, 588 0. 05 USD 825,000 DIRECTV FINAN 8. 8750% 01/02/30 144A 822, 729 0. 05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9. 2500% 01/04/29 144A 821, 867 0. 05 USD 1, 025,000 QVC INC 4. 3750% 01/09/28 817, 446 0. 05 USD 900,000 QUICKEN LOANS 3. 6250% 01/03/29 144A 899, 583 0. 05 USD 800,000 AAR ESCROW 6. 7500% 15/03/29 144A 808, 173 0. 05 USD 800,000 AAR ESCROW 6. 7500% 15/03/29 144A 806, 906 0. 05 USD 800,000 POST HOLDINGS 6. 2500% 15/02/25 144A 806, 906 0. 05 USD 925,000 HOWARD HUGHES 4. 3750% 01/02/31 144A 805, 034 0. 05 USD 925,000 HOWARD HUGHES 4. 3750% 01/02/31 144A 805, 534 0. 05 USD 825,000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 805, 534 0. 05 USD 825,000 ANTERO MIDSTAR MT 7. 1250% 01/02/32 144A 793, 943 0. 05 USD 825,000 ANTERO MIDSTR 5. 3750% 15/06/29 144A 793, 943 0. 05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/32 144A 793, 943 0. 05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/31 144A 793, 943 0. 05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/05/28 144A 792, 578 0. 05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/05/28 144A 792, 578 0. 05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/01/27 144A 787, 770 0. 05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/01/27 144A 787, 770 0. 05 USD 750,000 KNIFE RIVER C 7. 7500% 01/05/31 144A 787, 770 0. 05 USD 750,000 KNIFE RIVER C 7. 7500% 01/05/31 144A 785, 341 0. 05 USD 750,000 KNIFE RIVER C 7. 7500% 01/05/29 144A 772, 544 0. 05 USD 750,000 KNIFE RIVER C 7. 7500% 01/07/28 144A 770, 693 0. 05 USD 825,000 SRS DISTRIBUT 4. 4250% 01/07/28 144A 770, 693 0. 05 USD 765,000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 0. 05 USD 765,000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 0. 05 USD 775,000 HUGORP ENERG 6. 0000% 15/04/31 144A 760, 502 0. 05 USD 775,000 HUGORP ENERG 6. 2500% 15/04/32 144A 756, 501 0. 05 USD 775,000 HILCORP ENERG 6. 2500% 15/04/32 144A 756, 571 0. 05						
USD 829,000 WILLIAMS SCOT 6, 1250% 15/06/25 144A 825,958 0.05 USD 800,000 XPO INC 7. 1250% 01/02/32 823,588 0.05 USD 825,000 DIRECTY FINAN 8. 8750% 01/02/30 144A 822,729 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9. 2500% 01/04/29 144A 821, 867 0.05 USD 1, 025,000 QVC INC 4. 3750% 01/09/28 817, 446 0.05 USD 900,000 QUICKEN LOANS 3. 6250% 01/03/29 144A 809, 583 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6. 7500% 15/03/29 144A 808, 173 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6. 7500% 15/03/29 144A 806, 906 0.05 USD 800,000 POST HOLDINGS 6. 2500% 15/02/32 144A 805, 934 0.05 USD 800,000 POST HOLDINGS 6. 2500% 15/02/32 144A 805, 934 0.05 USD 800,000 HOWARD HUGHES 4. 3750% 01/02/31 144A 803, 788 0.05 USD 825,000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 800, 529 0.05 USD 825,000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 803, 788 0.05 USD 825,000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 792, 880 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/32 144A 792, 880 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/32 144A 792, 880 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/06/29 144A 792, 578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/01/27 144A 785, 341 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/01/27 144A 785, 341 0.05 USD 750,000 KNIFE RIVER C 7. 7500% 01/05/31 144A 785, 341 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/01/27 144A 785, 341 0.05 USD 750,000 KNIFE RIVER C 7. 7500% 01/05/31 144A 785, 341 0.05 USD 775,000 NAVIENT CORP 6. 75% 25/06/29 144A 772, 544 0.05 USD 825,000 SRS DISTRBUT 4. 6250% 01/07/28 144A 770, 693 0.05 USD 825,000 SRS DISTRBUT 4. 6250% 01/07/28 144A 770, 693 0.05 USD 765,000 WERTAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 0.05 USD 775,000 FRESTIGE BRAN 3. 7500% 01/07/28 144A 761, 391 0.05 USD 775,000 FRESTIGE BRAN 3. 7500% 01/07/28 144A 761, 391 0.05 USD 775,000 FRESTIGE BRAN 3. 7500% 01/07/28 144A 765, 571 0.05 USD 775,000 HILCORP ENERG 6. 0000% 15/04/30 144A 756, 371 0.05						
USD 800,000 XPO INC 7. 1250% 01/02/32 823,588 0.05 USD 825,000 DIRECTV FINAN 8. 8750% 01/02/30 144A 822,729 0.05 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9. 2500% 01/04/29 144A 821,867 0.95 USD 1,025,000 QVC INC 4. 3750% 01/09/28 817,446 0.05 USD 900,000 QUICKEN LOANS 3. 6250% 01/03/29 144A 809,583 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6. 7500% 15/03/29 144A 808, 173 0.95 USD 825,000 VICI PROPERTI 3. 5000% 15/03/29 144A 806,906 0.05 USD 800,000 POST HOLDINGS 6. 2500% 15/02/25 144A 806,906 0.05 USD 800,000 POST HOLDINGS 6. 2500% 15/02/25 144A 805,034 0.05 USD 925,000 HOWARD HUGHES 4. 3750% 01/02/31 144A 803,788 0.05 USD 825,000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 800,529 0.05 USD 825,000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/32 144A 793,943 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/32 144A 793,943 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/32 144A 792, 880 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/05/28 144A 792, 578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/05/28 144A 792, 578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/01/27 144A 787, 770 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/01/27 144A 787, 770 0.05 USD 750,000 KNIFE RIVER C 7. 7500% 01/05/31 144A 785, 341 0.05 USD 775,000 KNIFE RIVER C 7. 7500% 01/07/28 144A 772, 544 0.05 USD 800,000 JACOBS ENTERT 6. 7500% 15/02/29 144A 772, 544 0.05 USD 700,000 VITAL ENERGY INC 9. 7500% 15/02/29 144A 771, 750 0.05 USD 700,000 VITAL ENERGY INC 9. 7500% 15/02/29 144A 771, 750 0.05 USD 700,000 VITAL ENERGY INC 9. 7500% 15/02/29 144A 771, 750 0.05 USD 775,000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 0.05 USD 775,000 TRI POINTE GROUP 5. 7000% 15/06/28 762, 993 0.05 USD 775,000 TRI POINTE GROUP 5. 7000% 15/04/31 144A 761, 391 0.05 USD 775,000 HILCORP ENERG 6. 0000% 15/04/31 144A 760, 502 0.05 USD 775,000 HILCORP ENERG 6. 0000% 15/04/30 144A 756, 371 0.05		800, 000		827, 447	0.05	
USD 825,000 DIRECTV FINAN 8.8750% 01/02/30 144A 822,729 USD 800,000 ENCORE CAPITA 9.2500% 01/04/29 144A 821,867 0.05 USD 1,025,000 QVC INC 4.3750% 01/09/28 817,446 0.05 USD 900,000 QUICKEN LOANS 3.6250% 01/03/29 144A 809,583 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6.7500% 15/03/29 144A 808,173 0.05 USD 825,000 VICI PROPERTI 3.5000% 15/03/29 144A 806,906 0.05 USD 800,000 POST HOLDINGS 6.2500% 15/02/32 144A 805,034 0.05 USD 825,000 VICI PROPERTI 3.5000% 15/02/32 144A 805,034 0.05 USD 825,000 HOWARD HUGHES 4.3750% 01/02/31 144A 803,788 0.05 USD 825,000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 800,529 0.05 USD 825,000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 800,529 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7.1250% 01/02/32 144A 793,943 0.05 USD 800,000 ANTERO MIDSTR 5.3750% 15/06/29 144A 792,880 0.05 USD 800,000 CSC HOLDINGS 11.2500% 15/05/28 144A 792,578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/06/29 144A 792,578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/06/29 144A 792,578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/06/29 144A 785,7770 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/06/29 144A 785,341 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/06/29 144A 785,341 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/01/27 144A 785,341 0.05 USD 775,000 NAVIENT CORP 6.75% 25/06/25 781,029 0.05 USD 800,000 JACOBS ENTERT 6.7500% 01/05/31 144A 772,544 0.05 USD 800,000 JACOBS ENTERT 6.7500% 15/02/29 144A 772,544 0.05 USD 800,000 UVALENT CORP 6.75% 25/06/25 781,029 0.05 USD 800,000 UVALENT CORP 6.75% 25/06/25 781,029 0.05 USD 800,000 UVALENT CORP 6.75% 25/06/25 781,029 0.05 USD 800,000 UVALE NERGY INC 9.7500% 15/10/30 764,833 0.05 USD 700,000 UVALE NERGY INC 9.7500% 15/10/30 764,833 0.05 USD 700,000 UVALE NERGY INC 9.7500% 15/10/30 764,833 0.05 USD 800,000 BUILDERS FIRS 5.0000% 01/03/30 144A 765,572 0.05 USD 875,000 PRESTIGE BRAN 3.7500% 01/04/31 144A 760,502 0.05 USD 875,000 PRESTIGE BRAN 3.7500% 01/04/31 144A 766,502 0.05 USD 900,000 TEMPUR SEALY 3.8750% 15/10/31 144A 766,502 0.05 USD 775,000 HILCORP ENERG 6.2500% 15/04/30 144A 759,501 0.05 USD 775,000 HILCORP ENERG 6.2500% 15/04/30	USD	829, 000	WILLIAMS SCOT 6. 1250% 15/06/25 144A	825, 958	0.05	
USD 800,000 ENCORE CAPITA 9, 2500% 01/04/29 144A 821, 867 0.05 USD 1,025,000 QVC INC 4, 3750% 01/09/28 817, 446 0.05 USD 900,000 QUICKEN LOANS 3, 6250% 01/03/29 144A 809, 583 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6, 7500% 15/03/29 144A 808, 173 0.05 USD 825,000 VICI PROPERTI 3, 5000% 15/02/25 144A 806, 906 0.05 USD 800,000 POST HOLDINGS 6, 2500% 15/02/32 144A 805, 034 0.05 USD 925,000 HOWARD HUGHES 4, 3750% 01/02/31 144A 803, 788 0.05 USD 825,000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 800, 529 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7, 1250% 01/02/32 144A 793, 943 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7, 1250% 01/02/32 144A 793, 943 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7, 1250% 01/02/32 144A 792, 880 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 0000% 15/05/28 144A 792, 578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 0000% 15/05/28 144A 792, 578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 0000% 15/01/27 144A 785, 341 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6, 0000% 15/01/27 144A 785, 341 0.05 USD 750,000 KNIFE RIVER C 7, 7500% 01/05/31 144A 785, 341 0.05 USD 775,000 NAVIENT CORP 6, 75% 25/06/25 781,029 0.05 USD 800,000 JACOBS ENTERT 6, 7500% 15/02/29 144A 772, 544 0.05 USD 800,000 JACOBS ENTERT 6, 7500% 15/02/29 144A 772, 544 0.05 USD 800,000 SR DISTRIBUT 4, 6250% 01/07/28 144A 771, 750 0.05 USD 825,000 SR DISTRIBUT 4, 6250% 01/07/28 144A 770, 693 0.05 USD 700,000 VITAL ENERGY INC 9, 7500% 15/10/30 764, 833 0.05 USD 700,000 VITAL ENERGY INC 9, 7500% 15/10/30 764, 833 0.05 USD 700,000 WITAL ENERGY INC 9, 7500% 15/10/30 764, 833 0.05 USD 775,000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 0.05 USD 875,000 PRESTIGE BRAN 3, 75000% 15/06/28 762, 763, 993 0.05 USD 900,000 TEMPUR SEALY 3, 8750% 15/04/31 144A 760, 502 0.05 USD 900,000 TEMPUR SEALY 3, 8750% 15/04/31 144A 755, 501 0.05 USD 775,000 HILCORP ENERG 6, 2500% 15/10/31 144A 755, 501 0.05	USD	800,000	XPO INC 7.1250% 01/02/32	823, 588	0.05	
USD 1,025,000 QVC INC 4.3750% 01/09/28 817,446 0.05 USD 900,000 QUICKEN LOANS 3.6250% 01/03/29 144A 809,583 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6.7500% 15/03/29 144A 808,173 0.05 USD 825,000 VICI PROPERTI 3.5000% 15/02/25 144A 806,906 0.05 USD 800,000 POST HOLDINGS 6.2500% 15/02/22 144A 806,906 0.05 USD 925,000 HOWARD HUGHES 4.3750% 01/02/31 144A 803,788 0.05 USD 825,000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 800,529 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7.1250% 01/02/32 144A 793,943 0.05 USD 825,000 ANTERO MIDSTR 5.3750% 15/06/29 144A 792,880 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7.1250% 01/02/32 144A 792,880 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/01/27 144A 792,578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/01/27 144A 787,770 0.05 USD 750,000 KNIFE RIVER C 7.7500% 01/05/31 144A 787,770 0.05 USD 775,000 NAVIENT CORP 6.75% 25/06/25 781,029 0.05 USD 800,000 JACOBS ENTERT 6.7500% 01/05/31 144A 772,544 0.05 USD 800,000 USA FINIT CORP 6.75% 25/06/25 781,029 0.05 USD 800,000 JACOBS ENTERT 6.7500% 01/07/28 144A 772,544 0.05 USD 700,000 VITAL ENERGY INC 9.7500% 15/10/30 764,833 0.05 USD 766,000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/28 144A 763,572 0.05 USD 800,000 BUILDERS FIRS 5.0000% 01/07/28 144A 761,391 0.05 USD 775,000 PRESTIGE BRAN 3.7500% 01/04/31 144A 761,391 0.05 USD 900,000 TEMPUR SEALY 3.8750% 15/06/28 762,704 0.05 USD 900,000 TEMPUR SEALY 3.8750% 15/04/32 144A 760,501 0.05 USD 775,000 HILCORP ENERG 6.2500% 15/04/32 144A 756,501 0.05	USD	825, 000	DIRECTV FINAN 8.8750% 01/02/30 144A	822, 729	0.05	
USD 1,025,000 QVC INC 4.3750% 01/09/28 817,446 0.05 USD 900,000 QUICKEN LOANS 3.6250% 01/03/29 144A 809,583 0.05 USD 800,000 AAR ESCROW 6.7500% 15/03/29 144A 808,173 0.05 USD 825,000 VICI PROPERTI 3.5000% 15/02/25 144A 806,906 0.05 USD 800,000 POST HOLDINGS 6.2500% 15/02/22 144A 806,906 0.05 USD 925,000 HOWARD HUGHES 4.3750% 01/02/31 144A 803,788 0.05 USD 825,000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 800,529 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7.1250% 01/02/32 144A 793,943 0.05 USD 825,000 ANTERO MIDSTR 5.3750% 15/06/29 144A 792,880 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7.1250% 01/02/32 144A 792,880 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/01/27 144A 792,578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/01/27 144A 787,770 0.05 USD 750,000 KNIFE RIVER C 7.7500% 01/05/31 144A 787,770 0.05 USD 775,000 NAVIENT CORP 6.75% 25/06/25 781,029 0.05 USD 800,000 JACOBS ENTERT 6.7500% 01/05/31 144A 772,544 0.05 USD 800,000 USA FINIT CORP 6.75% 25/06/25 781,029 0.05 USD 800,000 JACOBS ENTERT 6.7500% 01/07/28 144A 772,544 0.05 USD 700,000 VITAL ENERGY INC 9.7500% 15/10/30 764,833 0.05 USD 766,000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/28 144A 763,572 0.05 USD 800,000 BUILDERS FIRS 5.0000% 01/07/28 144A 761,391 0.05 USD 775,000 PRESTIGE BRAN 3.7500% 01/04/31 144A 761,391 0.05 USD 900,000 TEMPUR SEALY 3.8750% 15/06/28 762,704 0.05 USD 900,000 TEMPUR SEALY 3.8750% 15/04/32 144A 760,501 0.05 USD 775,000 HILCORP ENERG 6.2500% 15/04/32 144A 756,501 0.05	USD	800, 000	ENCORE CAPITA 9. 2500% 01/04/29 144A	821, 867	0.05	
USD 900, 000 QUICKEN LOANS 3. 6250% 01/03/29 144A 809, 583 USD 800, 000 AAR ESCROW 6. 7500% 15/03/29 144A 808, 173 USD 825, 000 VICI PROPERTI 3. 5000% 15/02/25 144A 806, 906 USD 800, 000 POST HOLDINGS 6. 2500% 15/02/32 144A 805, 034 USD 925, 000 HOWARD HUGHES 4. 3750% 01/02/31 144A 803, 788 USD 825, 000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 800, 529 USD 800, 000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/32 144A 793, 943 USD 825, 000 ANTERO MIDSTR 5. 3750% 01/02/32 144A 793, 943 USD 825, 000 ANTERO MIDSTR 5. 3750% 15/06/29 144A 792, 880 USD 800, 000 CSC HOLDINGS 11. 2500% 15/06/29 144A 792, 578 USD 800, 000 KNIFE RIVER C 7. 7500% 01/02/31 144A 785, 341 USD 750, 000 KNIFE RIVER C 7. 7500% 01/05/31 144A 785, 341 USD 775, 000 NAVIENT CORP 6. 75% 25/06/25 781, 029 USD 800, 000 JACOBS ENTERT 6. 7500% 15/02/29 144A 772, 544 USD 1, 575, 000 LEVEL 3 FIN I 4. 2500% 01/07/28 144A 771, 750 USD 825, 000 SRS DISTRIBUT 4. 6250% 01/07/28 144A 770, 693 USD 700, 000 VITAL ENERGY INC 9. 7500% 15/10/30 764, 833 USD 765, 000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 USD 775, 000 TRI POINTE GROUP 5. 7000% 15/06/28 762, 704 USD 775, 000 TRI POINTE GROUP 5. 7000% 15/04/30 144A 761, 391 USD 900, 000 TEMPUR SEALY 3. 8750% 15/04/30 144A 760, 502 USD 900, 000 TEMPUR SEALY 3. 8750% 15/04/30 144A 765, 571 USD 775, 000 HILCORP ENERG 6. 0000% 15/04/30 144A 756, 371 USD 775, 000 HILCORP ENERG 6. 0000% 15/04/30 144A 756, 371 USD 775, 000 HILCORP ENERG 6. 0000% 15/04/30 144A 756, 371	USD		QVC INC 4.3750% 01/09/28	817, 446	0.05	
USD 800,000 AAR ESCROW 6.7500% 15/03/29 144A 808,173 0.05 USD 800,000 VICI PROPERTI 3.5000% 15/02/25 144A 806,906 0.05 USD 800,000 POST HOLDINGS 6.2500% 15/02/32 144A 805,034 0.05 USD 925,000 HOWARD HUGHES 4.3750% 01/02/31 144A 803,788 0.05 USD 825,000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 800,529 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/32 144A 793,943 0.05 USD 825,000 ANTERO MIDSTR 5.3750% 15/06/29 144A 793,943 0.05 USD 800,000 ANTIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/32 144A 792,880 0.05 USD 800,000 CSC HOLDINGS 11.2500% 15/05/28 144A 792,578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/01/27 144A 787,770 0.05 USD 750,000 KNIFE RIVER C 7.7500% 01/05/31 144A 785,341 0.05 USD 775,000 NAVIENT CORP 6.75% 25/06/25 781,029 0.05 USD 800,000 JACOBS ENTERT 6.7500% 15/02/29 144A 772,544 0.05 USD 1,575,000 LEVEL 3 FIN I 4.2500% 01/07/28 144A 771,750 0.05 USD 825,000 SRS DISTRIBUT 4.6250% 01/07/28 144A 770,693 0.05 USD 825,000 SRS DISTRIBUT 4.6250% 01/07/28 144A 770,693 0.05 USD 700,000 VITAL ENERGY INC 9.7500% 15/10/30 764,833 0.05 USD 765,000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763,993 0.05 USD 775,000 TRI POINTE GROUP 5.7000% 15/06/28 762,704 0.05 USD 875,000 PRESTIGE BRAN 3.7500% 01/04/31 144A 761,391 0.05 USD 900,000 TEMPUR SEALY 3.87500% 15/04/30 144A 760,502 0.05 USD 775,000 HILCORP ENERG 6.0000% 15/04/30 144A 759,501 0.05	USD			809, 583	0.05	
USD 825, 000 VICI PROPERTI 3. 5000% 15/02/25 144A 806, 906 USD 800, 000 POST HOLDINGS 6. 2500% 15/02/32 144A 805, 034 USD 925, 000 HOWARD HUGHES 4. 3750% 01/02/31 144A 803, 788 USD 825, 000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 800, 529 USD 800, 000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/32 144A 793, 943 USD 825, 000 ANTERO MIDSTR 5. 3750% 15/06/29 144A 792, 880 USD 825, 000 ANTERO MIDSTR 5. 3750% 15/06/29 144A 792, 880 USD 800, 000 CSC HOLDINGS 11. 2500% 15/05/28 144A 792, 578 USD 800, 000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/01/27 144A 787, 770 USD 800, 000 KNIFE RIVER C 7. 7500% 01/05/31 144A 785, 341 USD 750, 000 KNIFE RIVER C 7. 7500% 01/05/31 144A 785, 341 USD 775, 000 NAVIENT CORP 6. 75% 25/06/25 781, 029 USD 800, 000 JACOBS ENTERT 6. 7500% 15/02/29 144A 772, 544 USD 1, 575, 000 LEVEL 3 FIN 1 4. 2500% 01/07/28 144A 771, 750 USD 825, 000 SRS DISTRIBUT 4. 6250% 01/07/28 144A 771, 750 USD 700, 000 VITAL ENERGY INC 9. 7500% 15/10/30 764, 833 USD 765, 000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 USD 800, 000 BUILDERS FIRS 5. 0000% 15/06/28 762, 704 USD 775, 000 TRI POINTE GROUP 5. 7000% 15/06/28 762, 704 USD 900, 000 TEMPUR SCALY 3. 8750% 15/10/31 144A 761, 391 USD 900, 000 TEMPUR SCALY 3. 8750% 15/10/31 144A 761, 391 USD 900, 000 TEMPUR SCALY 3. 8750% 15/10/31 144A 769, 502 USD 775, 000 HILCORP ENERG 6. 0000% 15/04/31 144A 759, 501 USD 775, 000 HILCORP ENERG 6. 0000% 15/04/30 144A 759, 501	USD		AAR ESCROW 6, 7500% 15/03/29 144A	808, 173	0.05	
USD 800, 000 POST HOLDINGS 6. 2500% 15/02/32 144A 805, 034 0. 05 USD 925, 000 HOWARD HUGHES 4. 3750% 01/02/31 144A 803, 788 0. 05 USD 825, 000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 800, 529 0. 05 USD 800, 000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/32 144A 793, 943 0. 05 USD 825, 000 ANTERO MIDSTR 5. 3750% 15/06/29 144A 792, 880 0. 05 USD 800, 000 CSC HOLDINGS 11. 2500% 15/06/29 144A 792, 578 0. 05 USD 800, 000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/05/28 144A 792, 578 0. 05 USD 800, 000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/05/28 144A 787, 770 0. 05 USD 750, 000 KNIFE RIVER C 7. 7500% 01/05/31 144A 787, 770 0. 05 USD 750, 000 NAVIENT CORP 6. 75% 25/06/25 781, 029 0. 05 USD 800, 000 JACOBS ENTERT 6. 7500% 15/02/29 144A 772, 544 0. 05 USD 800, 000 JACOBS ENTERT 6. 7500% 15/02/29 144A 771, 750 0. 05 USD 825, 000 SRS DISTRIBUT 4. 6250% 01/07/28 144A 770, 693 0. 05 USD 825, 000 WITAL ENERGY INC 9. 7500% 15/10/30 764, 833 0. 05 USD 765, 000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 0. 05 USD 765, 000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 0. 05 USD 775, 000 TRI POINTE GROUP 5. 7000% 15/06/28 762, 704 0. 05 USD 875, 000 PRESTIGE BRAN 3. 7500% 01/03/30 144A 763, 572 0. 05 USD 875, 000 PRESTIGE BRAN 3. 7500% 01/03/30 144A 761, 391 0. 05 USD 900, 000 TEMPUR SEALY 3. 8750% 15/10/31 144A 760, 502 0. 05 USD 775, 000 HILCORP ENERG 6. 0000% 15/04/30 144A 756, 371 0. 05					0.05	
USD 925,000 HOWARD HUGHES 4. 3750% 01/02/31 144A 803, 788 0. 05 USD 825,000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 800, 529 0. 05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/32 144A 793, 343 0. 05 USD 825,000 ANTERO MIDSTR 5. 3750% 15/06/29 144A 792, 880 0. 05 USD 800,000 CSC HOLDINGS 11. 2500% 15/06/29 144A 792, 578 0. 05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/05/28 144A 792, 578 0. 05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/01/27 144A 787, 770 0. 05 USD 750,000 KNIFE RIVER C 7. 7500% 01/05/31 144A 785, 341 0. 05 USD 775, 000 NAVIENT CORP 6. 75% 25/06/25 781,029 0. 05 USD 800,000 JACOBS ENTERT 6. 7500% 15/02/29 144A 772, 544 0. 05 USD 1, 575,000 LEVEL 3 FIN I 4. 2500% 01/07/28 144A 771, 750 0. 05 USD 825,000 SRS DISTRIBUT 4. 6250% 01/07/28 144A 770, 693 0. 05 USD 825,000 SRS DISTRIBUT 4. 6250% 01/07/28 144A 770, 693 0. 05 USD 700,000 VITAL ENERGY INC 9. 7500% 15/10/30 764, 833 0. 05 USD 765,000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 0. 05 USD 775,000 TRI POINTE GROUP 5. 7000% 15/06/28 762,704 0. 05 USD 875,000 FRESTIGE BRAN 3. 7500% 01/04/31 144A 761, 391 0. 05 USD 900,000 PRESTIGE BRAN 3. 7500% 01/04/31 144A 760, 502 0. 05 USD 900,000 TEMPUR SEALY 3. 8750% 15/10/31 144A 760, 502 0. 05 USD 775,000 HILCORP ENERG 6. 2500% 15/04/30 144A 756, 371 0. 05						
USD 825,000 STANDARD IND 5% 15/02/27 144A 800,529 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 7.1250% 01/02/32 144A 793,943 0.05 USD 825,000 ANTERO MIDSTR 5.3750% 15/06/29 144A 792,880 0.05 USD 800,000 CSC HOLDINGS 11.2500% 15/05/28 144A 792,578 0.05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/01/27 144A 787,770 0.05 USD 750,000 KNIFE RIVER C 7.7500% 01/05/31 144A 785,341 0.05 USD 775,000 NAVIENT CORP 6.75% 25/06/25 781,029 0.05 USD 800,000 JACOBS ENTERT 6.7500% 15/02/29 144A 772,544 0.05 USD 1,575,000 LEVEL 3 FIN 1 4.2500% 15/02/29 144A 772,544 0.05 USD 800,000 JACOBS ENTERT 6.7500% 15/02/29 144A 771,750 0.05 USD 825,000 SRS DISTRIBUT 4.6250% 01/07/28 144A 770,693 0.05 USD 700,000 VITAL ENERGY INC 9.7500% 15/10/30 764,833 0.05 USD 765,000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763,993 0.05 USD 800,000 BUILDERS FIRS 5.0000% 15/06/28 762,704 0.05 USD 775,000 TRI POINTE GROUP 5.7000% 15/06/28 762,704 0.05 USD 900,000 TEMPUR SEALY 3.8750% 15/04/32 144A 760,502 0.05 USD 775,000 HILCORP ENERG 6.2500% 15/04/32 144A 759,501 0.05						
USD 800,000 NATIONSTAR MT 7. 1250% 01/02/32 144A 793, 943 0. 05 USD 825,000 ANTERO MIDSTR 5. 3750% 15/06/29 144A 792, 880 0. 05 USD 800,000 CSC HOLDINGS 11. 2500% 15/05/28 144A 792, 578 0. 05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/01/27 144A 787, 770 0. 05 USD 750,000 KNIFE RIVER C 7. 7500% 01/05/31 144A 785, 341 0. 05 USD 775,000 NAVIENT CORP 6. 75% 25/06/25 781, 029 0. 05 USD 800,000 JACOBS ENTERT 6. 7500% 15/02/29 144A 772, 544 0. 05 USD 1, 575, 000 LEVEL 3 FIN 1 4. 2500% 01/07/28 144A 771, 750 0. 05 USD 825, 000 SRS DISTRIBUT 4. 6250% 01/07/28 144A 770, 693 0. 05 USD 700,000 VITAL ENERGY INC 9. 7500% 15/10/30 764, 833 0. 05 USD 765, 000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 0. 05 USD 800,000 BUILDERS FIRS 5. 0000% 01/03/30 144A 763, 572 0. 05 USD 775, 000 TRI POINTE GROUP 5. 7000% 15/06/28 762, 704 0. 05 USD 875, 000 PRESTIGE BRAN 3. 7500% 01/04/31 144A 761, 391 0. 05 USD 900,000 TEMPUR SEALY 3. 8750% 15/10/30 144A 765, 502 0. 05 USD 775, 000 HILCORP ENERG 6. 2500% 15/04/30 144A 759, 501 0. 05 USD 775, 000 HILCORP ENERG 6. 0000% 15/04/30 144A 759, 501 0. 05			STANDARD IND 5% 15/02/27 144A			
USD 825, 000 ANTERO MIDSTR 5. 3750% 15/06/29 144A 792, 880 0. 05 USD 800, 000 CSC HOLDINGS 11. 2500% 15/05/28 144A 792, 578 0. 05 USD 800, 000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/01/27 144A 787, 770 0. 05 USD 750, 000 KNIFE RIVER C 7. 7500% 01/05/31 144A 785, 341 0. 05 USD 775, 000 NAVIENT CORP 6. 75% 25/06/25 781, 029 0. 05 USD 800, 000 JACOBS ENTERT 6. 7500% 15/02/29 144A 772, 544 0. 05 USD 1, 575, 000 LEVEL 3 FIN I 4. 2500% 01/07/28 144A 771, 750 0. 05 USD 825, 000 SRS DISTRIBUT 4. 6250% 01/07/28 144A 770, 693 0. 05 USD 825, 000 WITAL ENERGY INC 9. 7500% 15/10/30 764, 833 0. 05 USD 765, 000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 0. 05 USD 775, 000 TRI POINTE GROUP 5. 7000% 15/06/28 762, 704 0. 05 USD 775, 000 TRI POINTE GROUP 5. 7000% 15/06/28 762, 704 0. 05 USD 875, 000 PRESTIGE BRAN 3. 7500% 01/04/31 144A 761, 391 0. 05 USD 900, 000 TEMPUR SEALY 3. 8750% 15/10/31 144A 760, 502 0. 05 USD 775, 000 HILCORP ENERG 6. 2500% 15/04/30 144A 759, 501 0. 05			NATIONSTAR MT 7 1250% 01/02/32 1444			
USD 800,000 CSC HOLDINGS 11. 2500% 15/05/28 144A 792,578 0. 05 USD 800,000 NATIONSTAR MT 6. 0000% 15/01/27 144A 787,770 0. 05 USD 750,000 KNIFE RIVER C 7. 7500% 01/05/31 144A 785, 341 0. 05 USD 775,000 NAVIENT CORP 6. 75% 25/06/25 781,029 0. 05 USD 800,000 JACOBS ENTERT 6. 7500% 15/02/29 144A 772, 544 0. 05 USD 1, 575,000 LEVEL 3 FIN I 4. 2500% 01/07/28 144A 771,750 0. 05 USD 825,000 SRS DISTRIBUT 4. 6250% 01/07/28 144A 771,750 0. 05 USD 825,000 SRS DISTRIBUT 4. 6250% 01/07/28 144A 770,693 0. 05 USD 700,000 VITAL ENERGY INC 9. 7500% 15/10/30 764,833 0. 05 USD 765,000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763,993 0. 05 USD 800,000 BUILDERS FIRS 5. 0000% 01/03/30 144A 763,572 0. 05 USD 775,000 TRI POINTE GROUP 5. 7000% 15/06/28 762,704 0. 05 USD 875,000 PRESTIGE BRAN 3. 7500% 01/04/31 144A 761,391 0. 05 USD 900,000 TEMPUR SEALY 3. 8750% 15/10/31 144A 760,502 0. 05 USD 775,000 HILCORP ENERG 6. 2500% 15/04/32 144A 759,501 0. 05						
USD 800,000 NATIONSTAR MT 6.0000% 15/01/27 144A 787,770 0.05 USD 750,000 KNIFE RIVER C 7.7500% 01/05/31 144A 785,341 0.05 USD 775,000 NAVIENT CORP 6.75% 25/06/25 781,029 0.05 USD 800,000 JACOBS ENTERT 6.7500% 15/02/29 144A 772,544 0.05 USD 1,575,000 LEVEL 3 FIN I 4.2500% 01/07/28 144A 771,750 0.05 USD 825,000 SRS DISTRIBUT 4.6250% 01/07/28 144A 770,693 0.05 USD 700,000 VITAL ENERGY INC 9.7500% 15/10/30 764,833 0.05 USD 765,000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763,993 0.05 USD 800,000 BUILDERS FIRS 5.0000% 01/03/30 144A 763,572 0.05 USD 775,000 TRI POINTE GROUP 5.7000% 15/06/28 762,704 0.05 USD 875,000 PRESTIGE BRAN 3.7500% 01/04/31 144A 761,391 0.05 USD 900,000 TEMPUR SEALY 3.8750% 15/10/30 144A 765,502 0.05 USD 775,000 HILCORP ENERG 6.2500% 15/04/30 144A 759,501 0.05						
USD 750,000 KNIFE RIVER C 7.7500% 01/05/31 144A 785, 341 0.05 USD 775,000 NAVIENT CORP 6.75% 25/06/25 781,029 0.05 USD 800,000 JACOBS ENTERT 6.7500% 15/02/29 144A 772, 544 0.05 USD 1,575,000 LEVEL 3 FIN I 4.2500% 01/07/28 144A 771,750 0.05 USD 825,000 SRS DISTRIBUT 4.6250% 01/07/28 144A 770,693 0.05 USD 700,000 VITAL ENERGY INC 9.7500% 15/10/30 764,833 0.05 USD 765,000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763,993 0.05 USD 800,000 BUILDERS FIRS 5.0000% 01/03/30 144A 763,572 0.05 USD 775,000 TRI POINTE GROUP 5.7000% 15/06/28 762,704 0.05 USD 875,000 PRESTIGE BRAN 3.7500% 01/04/31 144A 761,391 0.05 USD 900,000 TEMPUR SEALY 3.8750% 15/10/31 144A 760,502 0.05 USD 775,000 HILCORP ENERG 6.2500% 15/04/32 144A 759,501 0.05						
USD 775, 000 NAVIENT CORP 6. 75% 25/06/25 781, 029 0. 05 USD 800, 000 JACOBS ENTERT 6. 7500% 15/02/29 144A 772, 544 0. 05 USD 1, 575, 000 LEVEL 3 FIN I 4. 2500% 01/07/28 144A 771, 750 0. 05 USD 825, 000 SRS DISTRIBUT 4. 6250% 01/07/28 144A 770, 693 0. 05 USD 700, 000 VITAL ENERGY INC 9. 7500% 15/10/30 764, 833 0. 05 USD 765, 000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 0. 05 USD 800, 000 BUILDERS FIRS 5. 0000% 01/03/30 144A 763, 572 0. 05 USD 775, 000 TRI POINTE GROUP 5. 7000% 15/06/28 762, 704 0. 05 USD 875, 000 PRESTIGE BRAN 3. 7500% 01/04/31 144A 761, 391 0. 05 USD 900, 000 TEMPUR SEALY 3. 8750% 15/10/31 144A 760, 502 0. 05 USD 775, 000 HILCORP ENERG 6. 2500% 15/04/30 144A 756, 371 0. 05						
USD 800,000 JACOBS ENTERT 6.7500% 15/02/29 144A 772,544 0.05 USD 1,575,000 LEVEL 3 FIN I 4.2500% 01/07/28 144A 771,750 0.05 USD 825,000 SRS DISTRIBUT 4.6250% 01/07/28 144A 770,693 0.05 USD 700,000 VITAL ENERGY INC 9.7500% 15/10/30 764,833 0.05 USD 765,000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763,993 0.05 USD 800,000 BUILDERS FIRS 5.0000% 01/03/30 144A 763,572 0.05 USD 775,000 TRI POINTE GROUP 5.7000% 15/06/28 762,704 0.05 USD 875,000 PRESTIGE BRAN 3.7500% 01/04/31 144A 761,391 0.05 USD 900,000 TEMPUR SEALY 3.8750% 15/10/31 144A 760,502 0.05 USD 775,000 HILCORP ENERG 6.2500% 15/04/32 144A 759,501 0.05 USD 775,000 HILCORP ENERG 6.0000% 15/04/30 144A 756,371 0.05						
USD 1, 575, 000 LEVEL 3 FIN I 4. 2500% 01/07/28 144A 771, 750 0. 05 USD 825, 000 SRS DISTRIBUT 4. 6250% 01/07/28 144A 770, 693 0. 05 USD 700, 000 VITAL ENERGY INC 9. 7500% 15/10/30 764, 833 0. 05 USD 765, 000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 0. 05 USD 800, 000 BUILDERS FIRS 5. 0000% 01/03/30 144A 763, 572 0. 05 USD 775, 000 TRI POINTE GROUP 5. 7000% 15/06/28 762, 704 0. 05 USD 875, 000 PRESTIGE BRAN 3. 7500% 01/04/31 144A 761, 391 0. 05 USD 900, 000 TEMPUR SEALY 3. 8750% 15/10/31 144A 760, 502 0. 05 USD 775, 000 HILCORP ENERG 6. 2500% 15/04/32 144A 759, 501 0. 05 USD 775, 000 HILCORP ENERG 6. 0000% 15/04/30 144A 756, 371 0. 05						
USD 825, 000 SRS DISTRIBUT 4. 6250% 01/07/28 144A 770, 693 0. 05 USD 700, 000 VITAL ENERGY INC 9. 7500% 15/10/30 764, 833 0. 05 USD 765, 000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 0. 05 USD 800, 000 BUILDERS FIRS 5. 0000% 01/03/30 144A 763, 572 0. 05 USD 775, 000 TRI POINTE GROUP 5. 7000% 15/06/28 762, 704 0. 05 USD 875, 000 PRESTIGE BRAN 3. 7500% 01/04/31 144A 761, 391 0. 05 USD 900, 000 TEMPUR SEALY 3. 8750% 15/10/31 144A 760, 502 0. 05 USD 775, 000 HILCORP ENERG 6. 2500% 15/04/32 144A 759, 501 0. 05 USD 775, 000 HILCORP ENERG 6. 0000% 15/04/30 144A 756, 371 0. 05						
USD 700, 000 VITAL ENERGY INC 9.7500% 15/10/30 764, 833 0.05 USD 765, 000 MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25 763, 993 0.05 USD 800, 000 BUILDERS FIRS 5.0000% 01/03/30 144A 763, 572 0.05 USD 775, 000 TRI POINTE GROUP 5.7000% 15/06/28 762, 704 0.05 USD 875, 000 PRESTIGE BRAN 3.7500% 01/04/31 144A 761, 391 0.05 USD 900, 000 TEMPUR SEALY 3.8750% 15/10/31 144A 760, 502 0.05 USD 775, 000 HILCORP ENERG 6. 2500% 15/04/30 144A 759, 501 0.05 USD 775, 000 HILCORP ENERG 6. 0000% 15/04/30 144A 756, 371 0.05						
USD     765,000     MERITAGE HOMES CORP 6% 01/06/25     763,993     0.05       USD     800,000     BUILDERS FIRS 5.0000% 01/03/30 144A     763,572     0.05       USD     775,000     TRI POINTE GROUP 5.7000% 15/06/28     762,704     0.05       USD     875,000     PRESTIGE BRAN 3.7500% 01/04/31 144A     761,391     0.05       USD     900,000     TEMPUR SEALY 3.8750% 15/10/31 144A     760,502     0.05       USD     775,000     HILCORP ENERG 6.2500% 15/04/32 144A     759,501     0.05       USD     775,000     HILCORP ENERG 6.0000% 15/04/30 144A     756,371     0.05						
USD 800, 000 BUILDERS FIRS 5.0000% 01/03/30 144A 763, 572 0.05 USD 775, 000 TRI POINTE GROUP 5.7000% 15/06/28 762, 704 0.05 USD 875, 000 PRESTIGE BRAN 3.7500% 01/04/31 144A 761, 391 0.05 USD 900, 000 TEMPUR SEALY 3.8750% 15/10/31 144A 760, 502 0.05 USD 775, 000 HILCORP ENERG 6.2500% 15/04/32 144A 759, 501 0.05 USD 775, 000 HILCORP ENERG 6.0000% 15/04/30 144A 756, 371 0.05						
USD     775, 000     TRI POINTE GROUP 5. 7000% 15/06/28     762, 704     0. 05       USD     875, 000     PRESTIGE BRAN 3. 7500% 01/04/31 144A     761, 391     0. 05       USD     900, 000     TEMPUR SEALY 3. 8750% 15/10/31 144A     760, 502     0. 05       USD     775, 000     HILCORP ENERG 6. 2500% 15/04/32 144A     759, 501     0. 05       USD     775, 000     HILCORP ENERG 6. 0000% 15/04/30 144A     756, 371     0. 05						
USD     875, 000     PRESTIGE BRAN 3.7500% 01/04/31 144A     761, 391     0.05       USD     900, 000     TEMPUR SEALY 3.8750% 15/10/31 144A     760, 502     0.05       USD     775, 000     HILCORP ENERG 6. 2500% 15/04/32 144A     759, 501     0.05       USD     775, 000     HILCORP ENERG 6. 0000% 15/04/30 144A     756, 371     0.05						
USD     900, 000     TEMPUR SEALY     3. 8750%     15/10/31     144A     760, 502     0. 05       USD     775, 000     HILCORP ENERG     6. 2500%     15/04/32     144A     759, 501     0. 05       USD     775, 000     HILCORP ENERG     6. 0000%     15/04/30     144A     756, 371     0. 05						
USD 775, 000 HILCORP ENERG 6. 2500% 15/04/32 144A 759, 501 0. 05 USD 775, 000 HILCORP ENERG 6. 0000% 15/04/30 144A 756, 371 0. 05						
USD 775,000 HILCORP ENERG 6.0000% 15/04/30 144A 756,371 0.05						
USD 825,000 LAMB WESTON H 4. 1250% 31/01/30 144A 752, 154 0. 04						
	USD	825, 000	LAMB WESTON H 4.1250% 31/01/30 144A	752, 154	0.04	

通貨	数量/額面(1)	銘柄	評価額	純資産比率(%)	
USD	725, 000	NABORS INDS I 9.1250% 31/01/30 144A	751, 236	0.04	
USD	800, 000	FORD MOTOR CRED 3. 8150% 02/11/27	750, 487	0.04	
USD	850, 000	CENTRAL GARDE 4. 1250% 30/04/31 144A	748, 127	0.04	
USD	825, 000	NCR VOYIX COR 5. 2500% 01/10/30 144A	746, 607	0.04	
USD	750, 000	SUNOCO LP/FIN 6. 0000% 15/04/27 WI	746, 449	0.04	
USD	775, 000	SPECTRUM BRAN 3. 8750% 15/03/31 144A	746, 191	0.04	
USD	825, 000	API GROUP DE 4. 1250% 15/07/29 144A	743, 310	0.04	
USD	1, 025, 000	SINCLAIR TELE 5.5000% 01/03/30 144A	741, 675	0.04	
USD	775, 000	MATTEL INC 3.3750% 01/04/26 144A	741, 025	0.04	
USD	800,000	ASHTON WOODS 4.6250% 01/08/29 144A	737, 605	0.04	
USD	825,000	PAYSAFE FIN P 4.0000% 15/06/29 144A	734, 567	0.04	
USD	700,000	VITAL ENERGY INC 10.1250% 15/01/28	734, 560	0.04	
USD	725,000	UNITED RENTAL 6.0000% 15/12/29 144A	730, 416	0.04	
USD	850,000	MPH ACQUISITI 5.5000% 01/09/28 144A	721, 906	0.04	
USD	775, 000	AVIS BUDGET C 5.3750% 01/03/29 144A	721, 363	0.04	
USD	675, 000	LIFEPOINT HE 11.0000% 15/10/30 144A	720, 885	0.04	
USD	650, 000	NFP CORP 8.5000% 01/10/31 144A	715, 952	0.04	
USD	775, 000	MATTEL INC 3.7500% 01/04/29 144A	713, 529	0.04	
USD	775, 000	CALPINE CORP 5.0000% 01/02/31 144A	711, 492	0.04	
USD	875, 000	COINBASE GLOB 3. 6250% 01/10/31 144A	710, 938	0.04	
USD	1,000,000	CSC HOLDINGS 4. 1250% 01/12/30 144A	709, 969	0.04	
USD	725, 000	OCEANEERING INTL 6.0000% 01/02/28	704, 327	0.04	
USD	775, 000	XEROX HOLDING 5.5000% 15/08/28 144A	703, 651	0.04	
USD	725, 000	QVC INC 4.4500% 15/02/25	702, 899	0.04	
USD	675, 000	US FOODS INC 7. 2500% 15/01/32 144A	701, 613	0.04	
USD	675, 000	DELTA AIR LINES 7. 3750% 15/01/26	696, 541	0.04	
USD	725, 000 700, 000	AVIS BUDGET C 5. 7500% 15/07/27 144A	695, 283	0.04	
USD	675, 000	OWENS & MINOR 6. 6250% 01/04/30 144A	691, 615	0.04	
USD USD	675, 000	NORTHERN OIL 8. 1250% 01/03/28 144A KODIAK GAS SE 7. 2500% 15/02/29 144A	687, 896 687, 205	0. 04 0. 04	
USD	675, 000	HF SINCLAIR C 6. 3750% 15/04/27 144A	679, 503	0.04	
USD	775, 000	UNITED RENTAL NA 3.7500% 15/01/32	675, 657	0.04	
USD	625, 000	EQM MIDSTREAM 7. 5000% 01/06/30 144A	666, 619	0.04	
USD	650, 000	FREE MTGE HOL 9. 2500% 01/02/29 144A	664, 771	0.04	
USD	675, 000	SPECTRUM BRAN 5. 0000% 01/10/29 144A	660, 656	0.04	
USD	725, 000	OUTFRONT MEDI 4. 2500% 15/01/29 144A	655, 250	0.04	
USD	675, 000	LAMAR MEDIA CORP 4.8750% 15/01/29	651, 499	0.04	
USD	675,000	POST HOLDINGS 5.5000% 15/12/29 144A	651, 436	0.04	
USD	700,000	ROCKET MTGE L 2. 8750% 15/10/26 144A	646, 941	0.04	
USD	625,000	EQM MIDSTREAM 7.5000% 01/06/27 144A	641, 654	0.04	
USD	625,000	GENESIS ENERGY 8.2500% 15/01/29	641, 131	0.04	
USD	750,000	IHEARTCOMMUNICAT 6.3750% 01/05/26	634, 601	0.04	
USD	700,000	TEMPUR SEALY 4.0000% 15/04/29 144A	634, 501	0.04	
USD	625, 000	REGAL REXNORD 6.0500% 15/04/28 144A	633, 103	0.04	
USD	700, 000	NATIONSTAR MT 5.1250% 15/12/30 144A	632, 656	0.04	
USD	675, 000	FAIR ISAAC CO 4.0000% 15/06/28 144A	629, 001	0.04	
USD	625, 000	ESAB CORP 6. 2500% 15/04/29 144A	628, 039	0.04	
USD	725, 000	CROCS INC 4. 1250% 15/08/31 144A	627, 802	0.04	
USD	700, 000	SONIC AUTOMOT 4. 6250% 15/11/29 144A	624, 941	0.04	
USD	625, 000	USA PART/USA FI 6.8750% 01/04/26 WI	623, 799	0.04	
USD	600, 000	BORR IHC/BOR 10. 0000% 15/11/28 144A	622, 162	0.04	
USD	650, 000	SERVICE PROP 5. 5000% 15/12/27	618, 425	0.04	
USD	600,000	IQVIA INC 6.5000% 15/05/30 144A	612, 548	0.04	
USD	1, 200, 000	CSC HOLDINGS 5. 0000% 15/11/31 144A	605, 123	0.04	
USD	600, 000	MERLIN ENTERT 7. 3750% 15/02/31 144A	604, 301	0.04	
USD	600, 000	GO DADDY OP/F 5. 2500% 01/12/27 144A	586, 975	0.03	
USD	585, 000	XEROX HOLDING 5. 0000% 15/08/25 144A	575, 771 573, 007	0.03	
USD	625, 000 550, 000	HILTON DOMEST 3.7500% 01/05/29 144A LIGHT & WONDE 7.5000% 01/09/31 144A	573, 007	0. 03 0. 03	
USD USD	575, 000	NEWELL BRANDS I 6.3750% 15/09/27	572, 343 565, 913	0.03	
USD	807, 000	CHS/COMMUNITY 6.8750% 01/04/28 144A	563, 278	0.03	
USD	575, 000	NEWELL BRANDS I 6. 6250% 15/09/29	560, 825	0.03	
COD	010,000	11211222 DIVINDO 1 0.0200/0 10/00/20	000, 020	0.00	

通貨	数量/額面(1)	銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	575, 000	NAVIENT CORP 5.0000% 15/03/27	550, 960	0.03
USD	625, 000	LAMAR MEDIA CORP 3. 6250% 15/01/31	547, 119	0.03
USD	650, 000	SLM CORP 5. 6250% 01/08/33 MTN	536, 154	0.03
USD	625, 000	CLEARWAY ENER 3. 7500% 15/02/31 144A	535, 518	0.03
USD	575, 000	PENNYMAC FIN 5. 7500% 15/09/31 144A	531, 346	0.03
USD	1, 350, 000	COMMSCOPE INC 7. 1250% 01/07/28 144A	530, 042	0.03
USD	575, 000	API GROUP DE 4.7500% 15/10/29 144A	529, 012	0. 03
USD	500,000	CUSHMAN & WAK 8.8750% 01/09/31 144A	528, 164	0. 03
USD	600,000	FORD MOTOR CRED 3.6250% 17/06/31	517, 909	0.03
USD	575,000	KONTOOR BRAND 4. 1250% 15/11/29 144A	517, 024	0.03
USD	500,000	KB HOME 7.2500% 15/07/30	516, 901	0.03
USD	550,000	NOVELIS CORP 3. 2500% 15/11/26 144A	512, 531	0.03
USD	600,000	ROCKET MTGE L 4.0000% 15/10/33 144A	507, 390	0.03
USD	550,000	MIWD HLD/MIWD 5.5000% 01/02/30 144A	505, 509	0.03
USD	475, 000	SERVICE PROP 8.6250% 15/11/31 144A	504, 804	0.03
USD	500,000	REGAL REXNORD 6.0500% 15/02/26 144A	503, 200	0.03
USD	500,000	MEDLINE BOR/C 6.2500% 01/04/29 144A	501, 865	0.03
USD	550, 000	LADDER CAP FI 4.7500% 15/06/29 144A	498, 690	0.03
USD	500,000	SM ENERGY CO 5.6250% 01/06/25	497, 551	0.03
USD	503, 000	MGM RESORTS 5.5000% 15/04/27	496, 550	0. 03
USD	500, 000	ENLINK MIDSTR 5. 6250% 15/01/28 144A	495, 016	0. 03
USD	500, 000	BEAZER HOMES USA 5. 8750% 15/10/27	490, 081	0. 03
USD	675, 000	REALOGY GRP / 5. 7500% 15/01/29 144A	479, 383	0.03
USD	475, 000	BEAZER HOMES 7. 5000% 15/03/31 144A	479, 315	0.03
USD	550, 000	NOVELIS CORP 3. 8750% 15/08/31 144A	471, 662	0.03
USD	450, 000	ACUSHNET 7. 3750% 15/10/28 144A	466, 189	0.03
USD	475, 000 500, 000	UNITED WHOLES 5. 7500% 15/06/27 144A	461, 941	0. 03 0. 03
USD	450, 000	LIVE NATION E 3.7500% 15/01/28 144A	461, 606 461, 372	0.03
USD USD	450, 000	REGAL REXNORD 6.3000% 15/02/30 LINDBLAD EXPE 6.7500% 15/02/27 144A	452, 390	0. 03
USD	425, 000	REGAL REXNORD 6. 4000% 15/04/33 144A	439, 809	0.03
USD	475, 000	NATIONSTAR MT 5.7500% 15/11/31 144A	436, 574	0.03
USD	450, 000	HESS MIDSTREA 5.5000% 15/10/30 144A	435, 703	0.03
USD	450, 000	VICI PROPERTI 3. 8750% 15/02/29 144A	414, 441	0.02
USD	450, 000	ASBURY AUTO G 4. 6250% 15/11/29 144A	414, 354	0. 02
USD	450,000	COMMERCIAL METAL 4. 1250% 15/01/30	413, 984	0. 02
USD	700,000	MILLENN ESCRO 6.6250% 01/08/26 144A	410, 674	0. 02
USD	450,000	ASBURY AUTO G 5.0000% 15/02/32 144A	406, 671	0.02
USD	450,000	COMMERCIAL METAL 4.3750% 15/03/32	405, 839	0.02
USD	800,000	CSC HOLDINGS 4.6250% 01/12/30 144A	405, 389	0.02
USD	450,000	COMPASS GRP L 5.0000% 15/01/32 144A	402, 553	0.02
USD	400,000	SPRINGLEAF FIN 6.6250% 15/01/28	401, 123	0.02
USD	400,000	NEW FORTRESS 8.7500% 15/03/29 144A	400, 482	0.02
USD	475, 000	CLEARWAY ENER 3.7500% 15/01/32 144A	399, 068	0.02
USD	400,000	VICI PROPERTI 3.7500% 15/02/27 144A	378, 897	0.02
USD	375, 000	MACY'S RETAIL 6. 1250% 15/03/32 144A	364, 846	0.02
USD	357, 000	CROWNROCK LP/ 5.0000% 01/05/29 144A	352, 658	0.02
USD	350, 000	MATADOR RESOU 6.5000% 15/04/32 144A	350, 830	0.02
USD	341,000	NEW FORTRESS 6. 7500% 15/09/25 144A	338, 676	0.02
USD	350, 000	ALLEGHENY TECH 4.8750% 01/10/29	329, 317	0.02
USD	325, 000	CRESCENT ENRG 7.6250% 01/04/32 144A	327, 770	0. 02
USD	520, 625	LUMEN TECH IN 4.1250% 15/04/29 144A	317, 581	0. 02
USD	350, 000	TEGNA INC 5. 0000% 15/09/29	313, 636	0. 02
USD	520, 625	LUMEN TECH IN 4. 1250% 15/04/30 144A	312, 375	0.02
USD	312,000	MATCH GROUP I 4. 6250% 01/06/28 144A	293, 975	0.02
USD	275, 000	FORTRESS TRAN 7.8750% 01/12/30 144A	288, 494	0.02
USD	274, 000	L BRANDS INC 9.3750% 01/07/25 144A	285, 644	0.02
USD USD	275, 000 275, 000	EQT MIDSTREAM PT 6.5000% 15/07/48 SEALED AIR/US 6.1250% 01/02/28 144A	275, 840 275, 298	0. 02 0. 02
USD	250, 000	AMC NETWORKS 10. 2500% 15/01/29 144A	275, 298 252, 188	0. 02
USD	250, 000	PHINIA INC 6.7500% 15/04/29 144A	252, 188 252, 097	0. 02
USD	275, 000	VICI PROPERTI 4. 1250% 15/08/30 144A	250, 379	0.02
COD	210,000	*101 1 101 EN11 1. 1200 /0 10/ 00/ 00 111A	200, 010	0.01

通貨 数量/額面(1)		銘柄	評価額	純資産比率(%)
USD	250, 000	MACY'S RETAIL 5.8750% 15/03/30 144A	242, 437	0.01
USD	225,000	AG TTMT ESCRO 8.6250% 30/09/27 144A	233, 007	0.01
USD	125,000	HOSPITALITY PROP 4. 9500% 15/02/27	115, 420	0.01
USD	150,000	HOSPITALITY PROP 4. 3750% 15/02/30	114, 015	0.01
USD	165,000	REALOGY GRP / 5. 2500% 15/04/30 144A	111, 544	0.01
USD	150,000	COMMSCOPE FIN 8. 2500% 01/03/27 144A	70, 451	0.00
USD	25,000	TAYLOR MORRIS 5. 7500% 15/01/28 144A	24, 743	0.00
			1, 242, 139, 096	74. 01
PFD 株式				
	16, 792	DIGICEL HDGS PFD 12.0000% 31/12/49	167, 920	0.01
			167, 920	0.01
		アメリカ計	1, 260, 864, 088	75. 12
		組入資産合計	1, 589, 407, 287	94. 68

#### (1)額面は発行通貨建て表示

# 外国為替先渡し契約

2024年3月28日現在

					2024年 3 月 28 日 現任
	通貨(買い)		通貨(売り)	満期日	未実現損益(米ドル)
				0.4774	.,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,
TRY	27, 792, 880	USD	824, 294	April 22, 2024	9, 842
TRY	27, 348, 372	USD	824, 294	April 09, 2024	9, 815
AUD	97, 309	USD	63, 166	April 09, 2024	389
MXN	50, 750, 000	USD	2, 942, 762	April 26, 2024	109, 397
MXN	27, 050, 000	USD	1, 564, 795	April 12, 2024	65, 586
MXN	34, 250, 000	USD	1, 996, 141	June 07, 2024	49, 506
MXN	38, 150, 000	USD	2, 236, 002	May 24, 2024	47, 606
ZAR	30, 050, 000	USD	1, 550, 804	May 15, 2024	30, 419
BRL	11, 650, 000	USD	2, 292, 449	June 07, 2024	25, 103
PLN	8, 790, 000	USD	2, 187, 556	April 05, 2024	15, 873
ZAR	29, 250, 000	USD	1, 529, 782	April 22, 2024	12, 349
PLN	6, 160, 000	USD	1, 534, 985	April 22, 2024	8,922
USD	2, 211, 931	PLN	8, 790, 000	April 05, 2024	8, 502
BRL	7, 850, 000	USD	1, 564, 118	April 12, 2024	5, 716
USD	2, 451, 154	ZAR	46, 400, 000	April 05, 2024	1, 526
USD	1, 715, 687	INR	143, 000, 000	April 05, 2024	758
INR	143, 000, 000	USD	1, 715, 358	April 05, 2024	(429)
INR	143, 000, 000	USD	1, 712, 197	June 14, 2024	(829)
ZAR	46, 400, 000	USD	2, 437, 077	June 14, 2024	(1, 852)
INR	119, 850, 000	USD	1, 439, 316	April 22, 2024	(2, 590)
INR	156, 450, 000	USD	1, 881, 408	May 15, 2024	(7, 201)
PLN	6, 570, 000	USD	1, 654, 725	May 15, 2024	(8, 464)
PLN	8, 790, 000	USD	2, 210, 328	June 14, 2024	(8, 605)
INR	155, 900, 000	USD	1, 878, 557	May 30, 2024	(11, 796)
ZAR	46, 400, 000	USD	2, 462, 690	April 05, 2024	(13, 063)
BRL	9, 650, 000	USD	1, 941, 571	May 24, 2024	(19, 405)
PLN	8, 090, 000	USD	2, 052, 330	May 31, 2024	(25, 566)
BRL	16, 454, 000	USD	3, 311, 663	April 26, 2024	(26, 131)
ZAR	41, 600, 000	USD	2, 212, 357	May 31, 2024	(26, 375)
AUD	105, 994, 918	USD	68, 807, 937	April 09, 2024	420, 349
MXN	129, 832, 857	USD	7, 608, 846	April 09, 2024	220, 256
MXN	128, 947, 459	USD	7, 667, 655	April 22, 2024	92, 278
TRY	222, 855, 868	USD	6, 610, 697	April 22, 2024	77, 785
TRY	227, 494, 480	USD	6, 895, 837	April 09, 2024	42, 607
USD	1, 105, 015	BRL	5, 511, 820	May 03, 2024	5, 106

通貨(	買い)		通貨 (売り)	満期日	未実現損益(米ドル)
USD	1,022,772	AUD	1, 558, 744	April 09, 2024	4,712
USD	134, 984	TRY	4, 413, 168	April 09, 2024	386
USD	17, 869	TRY	584, 218	April 09, 2024	51
USD	19, 252	MXN	325, 068	April 09, 2024	(349)
USD	83, 333	AUD	128, 294	April 22, 2024	(490)
USD	28,090	MXN	474, 291	April 09, 2024	(509)
JPY	10, 399, 851	USD	69, 499	April 09, 2024	(653)
USD	51, 555	MXN	872, 566	April 22, 2024	(954)
USD	60, 925	MXN	1, 026, 554	April 09, 2024	(978)
USD	64, 221	TRY	2, 138, 825	April 09, 2024	(1, 012)
JPY	8, 950, 830	USD	60, 512	April 22, 2024	(1, 141)
JPY	411, 214, 620	USD	2,748,030	April 09, 2024	(25, 818)
JPY	362, 622, 304	USD	2, 451, 511	April 22, 2024	(46, 226)
AUD	106, 257, 403	USD	69, 740, 506	April 22, 2024	(314, 557)
BRL	1, 117, 324, 373	USD	223, 771, 428	May 03, 2024	(804, 095)
JPY	15, 022, 793, 121	USD	100, 393, 062	April 09, 2024	(943, 202)
JPY	14, 865, 588, 683	USD	100, 498, 955	April 22, 2024	(1, 895, 036)
USD	458, 871	JPY	67, 338, 960	April 09, 2024	13, 092
USD	388, 361	JPY	56, 991, 680	April 09, 2024	11, 081
USD	270, 392	JPY	40, 002, 512	April 22, 2024	5,054
USD	564, 772	JPY	84, 701, 240	April 09, 2024	4,056
USD	135, 729	JPY	20, 003, 158	April 09, 2024	3, 310
USD	68, 439	JPY	10, 002, 240	April 09, 2024	2, 226
USD	68, 173	JPY	10, 004, 386	April 09, 2024	1,945
USD	67, 945	JPY	10, 007, 146	April 09, 2024	1,699
USD	13, 536	JPY	1, 986, 420	April 09, 2024	386
USD	20, 314	JPY	3, 005, 332	April 22, 2024	380
USD	6, 849	JPY	1,000,960	April 09, 2024	223
USD	6, 827	JPY	1,001,912	April 09, 2024	195
USD	6, 829	JPY	1,005,854	April 09, 2024	171
USD	6, 828	JPY	1,006,402	April 09, 2024	167
USD	6, 771	JPY	1,001,817	April 22, 2024	127
USD	3, 420	JPY	503, 704	April 09, 2024	86
USD	3, 417	JPY	503, 704	April 09, 2024	83
USD	3, 370	JPY	502, 045	April 09, 2024	47
USD	1, 249	JPY	183, 340	April 09, 2024	36
USD	3, 353	JPY	501, 887	April 09, 2024	31
USD	561, 799	JPY	85, 004, 480	April 22, 2024	(2, 038)
JPY	498, 498	ÜSD	3, 305	April 22, 2024	1
					(2, 880, 129)

2024年3月28日現在の外国為替およびデリバティブ取引に関する証拠金2,180,000米ドル。

# 野村マネー マザーファンド

# 運用報告書

第22期(決算日2024年8月19日)

作成対象期間(2023年8月22日~2024年8月19日)

# 受益者のみなさまへ

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

#### ●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運 用 方 針 本邦通貨表示の公社債等に投資を行ない、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行ないます。

主な投資対象本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。

主な投資制限 株式への投資は行ないません。

# 野村アセットマネジメント株式会社

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

https://www.nomura-am.co.jp/

# 〇最近5期の運用実績

決	算	期	基	準	期騰	落	額 中 率	債組	入	比	券率	債先	物	比	券率	純総	資	産額
				円			%				%				%			百万円
18期(	(2020年8月	19日)		10, 203			△0.0			6	88. 2				_			3, 175
19期(	(2021年8月	19日)		10, 200			△0.0			6	50. 1				_			9, 159
20期(	(2022年8月	19日)		10, 199			△0.0			5	57. 5				_			7, 850
21期(	(2023年8月2	21日)		10, 196			△0.0				5. 7				_			6, 733
22期(	(2024年8月	19日)		10, 198			0.0			6	57. 7				_			3, 413

<sup>\*</sup>債券先物比率は買い建て比率一売り建て比率。

# 〇当期中の基準価額と市況等の推移

			基	進	Įπ.		物石	,			Nt.	644			Nt.
年	月	日	基	华	価		額	債	-1	1.1.	券	債	th/m		券 率
					騰	落	率	組	入	比	率	先	物	比	
	(期 首)			円			%				%				%
	2023年8月21日			10, 196			_				5.7				
	8月末			10, 196			0.0				5.3				_
	9月末			10, 195			△0.0				10.5				
	10月末			10, 195			△0.0				9.3				
	11月末			10, 195			$\triangle 0.0$				12.6				_
	12月末			10, 194			△0.0				10.1				
	2024年1月末			10, 194			△0.0				4.3				
	2月末			10, 194			△0.0				5.6				
	3月末			10, 194			△0.0				11.7				
	4月末			10, 195			△0.0				28. 1				
	5月末			10, 196			0.0				64. 1				
	6月末			10, 196			0.0				55. 7				
	7月末			10, 197			0.0				3.8				_
	(期 末)														
	2024年8月19日			10, 198			0.0				67.7				_

<sup>\*</sup>騰落率は期首比です。

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

<sup>\*</sup>債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

#### ◎運用経過

#### 〇期中の基準価額等の推移



#### 〇基準価額の主な変動要因

投資している短期有価証券のインカムゲイン(利子収入)等。

#### 〇投資環境

国内経済は、緩やかな回復が続きました。このような中、日銀は2023年10月に実質的な長期金利の上限+1%を「上限の目途」と変更しました。また2024年3月にはイールドカーブ・コントロールの運用やマイナス金利政策を解除するとともに、無担保コール翌日物レートの誘導目標を $0\sim0.1\%$ 程度とし、7月には $0\sim0.1\%$ 程度から0.25%程度への引き上げを決定しました。

TDB(国庫短期証券)3ヵ月物の利回りおよび無担保コール翌日物レートは期首よりそれぞれ-0.3%~-0.1%程度、-0.1%~0%程度で推移しましたが、上記のような環境のもとで、期末にかけてはそれぞれ0.1%前後、0.23%程度で推移しました。

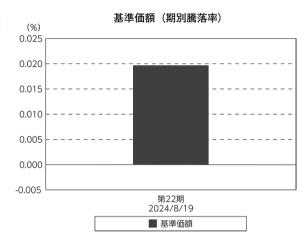
#### 〇当ファンドのポートフォリオ

残存1年以内の公社債等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図りました。

#### 〇当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価 額騰落率です。



# ◎今後の運用方針

残存1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図って運用いたします。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

該当事項はございません。

#### 〇売買及び取引の状況

(2023年8月22日~2024年8月19日)

#### 公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
	国債証券	217, 190, 000	215, 090, 584
玉	地方債証券	570, 798	-
			( 720, 000)
	特殊債券	1, 241, 289	_
内			( 1, 164, 000)
	社債券(投資法人債券を含む)	120, 046	_
			( 220,000)

<sup>\*</sup>金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

#### 〇利害関係人との取引状況等

(2023年8月22日~2024年8月19日)

# 利害関係人との取引状況

		四八烷水			主从姤炊			
区	分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	<u>B</u> A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	<u>D</u> C	
		百万円	百万円	%	百万円	百万円	%	
公社債		1, 932	157	8. 1	ļ	_	_	

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

<sup>\*</sup>単位未満は切り捨て。

<sup>\*()</sup>内は償還等による増減分です。

<sup>\*</sup>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。

#### 国内公社債

#### (A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

(11) [ ] () [ ]	,		1五/外/77/	., .										
							当			期		末		
区	分	額面	金額	評	/ш:	額	<b>√</b> П	7	比 率	うちΒ	B格以下	残有	期間別組入	比率
		額面	金額	計	価	111 00	組	入	九十	組入	. 比 率	5年以上	2年以上	2年未満
			千円		-	千円			%		%	%	%	%
<b>京</b>   本		2,	100,000		2, 100,	,000			61.5		_	61. 5	_	_
国債証券		(2,	100,000)	(	2, 100,	(000)			(61.5)		(-)	(61.5)	(-)	( -)
地方債証券			80,000		80,	, 030			2.3		_	_	_	2.3
地刀頂証分		(	80,000)	(	80,	030)			(2.3)		(-)	( -)	(-)	(2.3)
特殊債券			130,000		130,	078			3.8		_	_	_	3.8
(除く金融債)		(	130, 000)	(	130,	078)			(3.8)		(-)	( -)	(-)	(3.8)
A	計	2,	310,000		2, 310,	, 108			67.7		_	61.5	_	6.2
合	計	(2,	310, 000)	(	2, 310,	108)			(67.7)		(-)	(61.5)	(-)	(6.2)

<sup>\*()</sup>内は非上場債で内書きです。

#### (B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘	柄		当	期 末	
<b>並</b>	11/3	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
国債バスケット(変動利付・利付	・国庫短期証券)※	_	2, 100, 000	2, 100, 000	_
小	計		2, 100, 000	2, 100, 000	
地方債証券					
相模原市 公募平成26年度第1[	目	0. 529	80,000	80, 030	2024/9/20
小	計		80,000	80, 030	
特殊債券(除く金融債)					
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第225回	0. 556	50,000	50, 007	2024/8/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第229回	0. 539	80,000	80, 071	2024/10/31
小	計		130,000	130, 078	
合	計		2, 310, 000	2, 310, 108	

<sup>\*</sup>額面・評価額の単位未満は切り捨て。

<sup>\*</sup>組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

<sup>\*</sup>金額の単位未満は切り捨て。

<sup>\*</sup>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。

<sup>\*</sup>残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

<sup>\*※</sup>印は現先で保有している債券です。

#### ○投資信託財産の構成

(2024年8月19日現在)

項	П		当	其	東 末	
· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	Ħ		価	額	比	率
				千円		%
公社債				2, 310, 108		55. 3
コール・ローン等、その他				1, 867, 200		44. 7
投資信託財産総額				4, 177, 308		100.0

<sup>\*</sup>金額の単位未満は切り捨て。

#### ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年8月19日現在)

_		
	項    目	当期末
		H
(A)	資産	4, 177, 308, 064
	コール・ローン等	1, 785, 184, 058
	公社債(評価額)	2, 310, 108, 969
	未収利息	174, 151
	前払費用	71, 886
	差入委託証拠金	81, 769, 000
(B)	負債	763, 418, 000
	未払解約金	763, 418, 000
(C)	純資産総額(A-B)	3, 413, 890, 064
	元本	3, 347, 617, 461
	次期繰越損益金	66, 272, 603
(D)	受益権総口数	3, 347, 617, 461 □
	1万口当たり基準価額(C/D)	10, 198円

<sup>(</sup>注) 期首元本額は6,603,862,387円、期中追加設定元本額は23,993,903,041円、期中一部解約元本額は27,250,147,967円、1口当たり純資産額は1.0198円です。

#### 〇損益の状況

(2023年8月22日~2024年8月19日)

	項目	当 期
		円
(A)	配当等収益	3, 208, 786
	受取利息	3, 779, 241
	その他収益金	175, 069
	支払利息	△ 745, 524
(B)	有価証券売買損益	△ 2, 200, 748
	売買益	45, 802
	売買損	$\triangle$ 2, 246, 550
(C)	当期損益金(A+B)	1, 008, 038
(D)	前期繰越損益金	129, 271, 098
(E)	追加信託差損益金	467, 816, 959
(F)	解約差損益金	△531, 823, 492
(G)	計(C+D+E+F)	66, 272, 603
	次期繰越損益金(G)	66, 272, 603

- \*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(E)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(F)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。

#### 〇当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
ファント名	元本額
	円
野村世界業種別投資シリーズ (マネープール・ファンド)	1, 407, 593, 108
野村アンジェロ・ゴードンBDCファンド (為替ヘッジあり) 2210 (適格機関投資家転売制限付)	1, 110, 121, 107
ノムラ・プライベート・シリーズTPGアンジェロ・ゴードンEDCファンド (為替ヘッジあり) 2402 (適格機関投資家販売制限付)	351, 175, 044
ノムラ・アジア・シリーズ (マネープール・ファンド)	241, 254, 938
野村DC運用戦略ファンド	85, 180, 134
野村世界高金利通貨投信	34, 318, 227
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7, 492, 405
ネクストコア	2, 282, 012
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信 (円コース) 毎月分配型	984, 834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984, 834

フーンバタ	当期末
ファンド名	元本額
	円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信 (アジア通貨コース) 毎月分配型	984, 834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	984, 834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984, 834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984, 834
野村グローバルCB投信(円コース)毎月分配型	984, 543
野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984, 543
野村グローバルCB投信 (アジア通貨コース) 毎月分配型	984, 543
野村グローバルCB投信(円コース)年2回決算型	984, 543
野村グローバルCB投信 (資源国通貨コース) 年2回決算型	984, 543
野村グローバルCB投信 (アジア通貨コース) 年2回決算型	984, 543

ファンド名	当期末
7 7 7 TA	元本額
	円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信 (円コース) 毎月分配型	984, 252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信 (豪ドルコース) 毎月分配型	984, 252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信 (ブラジルレアルコース) 毎月分配型	984, 252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)年2回決算型	984, 252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)年2回決算型	984, 252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型	984, 252
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	983, 768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	983, 768
野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型	983, 768
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	983, 768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	983, 768
ノムラ・グローバルトレンド (円コース) 毎月分配型	983, 672
ノムラ・グローバルトレンド (資源国通貨コース) 毎月分配型	983, 672
ノムラ・グローバルトレンド (アジア通貨コース) 毎月分配型	983, 672
ノムラ・グローバルトレンド (円コース) 年2回決算型	983, 672
ノムラ・グローバルトレンド (資源国通貨コース) 年2回決算型	983, 672
ノムラ・グローバルトレンド (アジア通貨コース) 年2回決算型	983, 672
野村テンプルトン・トータル・リターン Aコース	983, 381
野村テンプルトン・トータル・リターン Cコース	983, 381
野村テンプルトン・トータル・リターン Dコース	983, 381
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	983, 091
野村グローバル高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型	983, 091
野村グローバル高配当株プレミアム (円コース) 年2回決算型	983, 091
野村グローバル高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	983, 091
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982, 898
野村アジアハイ・イールド債券投信 (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982, 898
野村アジアハイ・イールド債券投信 (アジア通貨セレクトコース) 毎月分配型	982, 898
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	982, 898
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	982, 898
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)年2回決算型	982, 898
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	982, 801
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(欧州通貨コース)	982, 609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円コース)	982, 609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(豪ドルコース)	982, 609
野村日本ブランド株投資(円コース)毎月分配型	982, 609
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	982, 609
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	982, 609
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	982, 609
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	982, 609
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型 野村ドイチャ・京和サインフラ関連性投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982, 609
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)毎月分配型 野科大学・世界 京会 利山南 佐 セノラ	982, 609 982, 608
野村新世界高金利通貨投信 野村米国ハイ・イールド債券投信 (円コース) 毎月分配型	982, 608
野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982, 608
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型	982, 608
野村米国ハイ・イールド債券投信(アノブルレアルコース)毎月万配至 野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型	982, 608
野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	982, 608
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型	982, 608
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)毎月分配型	982, 608
野村日本ブランド株投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	982, 608
野村日本ブランド株投資(円コース)年2回決算型	982, 608
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)年2回決算型	982, 608
野村日本ブランド株投資 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型	982, 608
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)年2回決算型	982, 608
野村新エマージング債券投信(円コース)毎月分配型	982, 608
野村新エマージング債券投信(ブラジルレアルコース)毎月分配型	982, 608
野村新エマージング債券投信 (インドネシアルピアコース) 毎月分配型	982, 608
野村新エマージング債券投信 (円コース) 年2回決算型	982, 608
/ 1	

7 - 1/1/2	当期末
ファンド名	元本額
	H
野村新エマージング債券投信 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型	982, 608
野村新エマージング債券投信(中国元コース)年2回決算型	982, 608
野村アジアCB投信(毎月分配型)	982, 608
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型	982, 608
野村グローバルREITプレミアム(円コース)毎月分配型	982, 608
野村グローバルREITプレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982, 608
野村グローバルREITプレミアム(円コース)年2回決算型	982, 608
野村グローバルREITプレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	982, 608
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)毎月分配型	982, 607
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982, 607
野村新エマージング債券投信(中国元コース)毎月分配型	982, 607
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)毎月分配型	982, 607
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	982, 607
野村日本高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	982, 415
野村日本高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982, 415
野村日本高配当株プレミアム (円コース) 年2回決算型	982, 415
野村日本高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	982, 415
野村高配当インフラ関連株プレミアム (円コース) 毎月分配型	982, 029
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982, 029
野村高配当インフラ関連株プレミアム (円コース) 年2回決算型	982, 029
野村高配当インフラ関連株プレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	982, 029
野村カルミニャック・ファンド Aコース	981, 547
野村カルミニャック・ファンド Bコース	981, 547
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)毎月分配型	981, 451
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)年2回決算型	981, 451
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981, 451
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981, 451
ノムラ THE USA Aコース	981, 258
ノムラ THE USA Bコース	981, 258
野村高配当インフラ関連株ファンド (米ドルコース) 毎月分配型	980, 297
野村高配当インフラ関連株ファンド (通貨セレクトコース) 毎月分配型	980, 297
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)年2回決算型	980, 297
グローバル・ストック Bコース	979, 528
野村日本高配当株エンハンスト戦略 (除く金融) オープン (適格機関投資家専用)	931, 647
野村通貨選択日本株投信 (メキシコペソコース) 毎月分配型	626, 503
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	491, 401
野村通貨選択日本株投信 (ブラジルレアルコース) 毎月分配型	398, 357
野村通貨選択日本株投信 (メキシコペソコース) 年2回決算型	373, 897
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)毎月分配型	177, 539
野村通貨選択日本株投信 (豪ドルコース) 年2回決算型	132, 547
グローバル・ストック Dコース	116, 529
野村通貨選択日本株投信(ブラジルレアルコース)年2回決算型	100, 946
野村米国ハイ・イールド債券投信 (通貨セレクトコース) 年2回決算型	98, 262
野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	98, 261
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	98, 261
野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	98, 261
野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	98, 261
野村新エマージング債券投信(米ドルコース)毎月分配型	98, 261
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	98, 261
野村新エマージング債券投信(米ドルコース)年2回決算型	98, 261
野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	98, 261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)毎月分配型	98, 261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)年2回決算型	98, 261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)年2回決算型	98, 261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型	98, 261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	98, 261
野村米国ブランド株投資(円コース)毎月分配型	98, 261
野村テンプルトン・トータル・リターン Bコース	98, 261
[ zi/ii / v v /v r v · r · y /v · y y · v · Da · A	50, 201

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	98, 261
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98, 260
ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Aコース	98, 078
ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Bコース	98, 078
野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Aコース	98, 059
野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Bコース	98, 059
マイライフ・エール(資産成長型)	98, 049
マイライフ・エール (年2%目標払出型)	98, 049
マイライフ・エール(年6%目標払出型)	98, 049
野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース	98, 020
野村環境リーダーズ戦略ファンド Bコース	98, 020
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Aコース	98, 011
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Bコース	98, 011
(年3%目標払出)のむラップ・ファンド(普通型)	98, 001
(年6%目標払出)のむラップ・ファンド(普通型)	98, 001
グローバル・ストック Aコース	97, 953
グローバル・ストック Cコース	97, 953
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	9,826
野村DCテンプルトン・トータル・リターン Aコース	9,818
野村DCテンプルトン・トータル・リターン Bコース	9,818
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,809
野村アバンティス米国小型株ファンド Aコース(野村SMA・EW向け)	9,809
野村アバンティス米国小型株ファンド Bコース(野村SMA・EW向け)	9,809
野村アバンティス新興国株ファンド Aコース(野村SMA・EW向け)	9, 809
野村アバンティス新興国株ファンド Bコース(野村SMA・EW向け)	9,809
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,808

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信 (メキシコペソコース) 年2回決算型	9,808
野村PIMCO・トレンド戦略ファンド(米ドル売り円買い)(野村SMA・EW向け)	9,808
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9, 807
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9, 807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9, 807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9, 807
ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Aコース(野村SMA・EW向け)	9,806
ウエリントン・企業価値共創世界株ファンド Bコース(野村SMA・EW向け)	9,806
野村高配当インフラ関連株ファンド (円コース) 毎月分配型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド (円コース) 年2回決算型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド (通貨セレクトコース) 年2回決算型	9,803
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	9,801
野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)	9,801
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)毎月分配型	9, 797
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型	9, 797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Aコース	9, 797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Bコース	9, 797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Cコース	9, 797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Dコース	9, 797
野村ファンドラップ債券プレミア	9, 795
野村ファンドラップオルタナティブプレミア	9, 795
野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース (野村SMA・EW向け)	9, 794
野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース (野村SMA・EW向け)	9, 794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け)	9, 794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース (野村SMA・EW向け)	9, 794

# 〇お知らせ