

# 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

## 運用報告書(全体版)

第143期(決算日2022年4月15日) 第144期(決算日2022年5月16日) 第145期(決算日2022年6月15日)  
第146期(決算日2022年7月15日) 第147期(決算日2022年8月15日) 第148期(決算日2022年9月15日)

作成対象期間 (2022年3月16日～2022年9月15日)

### 受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                                                                                                   |  |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|
| 商品分類   | 追加型投信／海外／債券                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                   |  |
| 信託期間   | 2010年4月23日から2025年3月17日までです。                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                   |  |
| 運用方針   | 主として、円建ての外国投資信託であるノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドグローバル・ハイ・イールド・ボンドアジア通貨クラス受益証券および円建ての国内籍の投資信託である野村マネー マザーファンド受益証券への投資を通じて、世界のハイ・イールド債券を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目指します。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドグローバル・ハイ・イールド・ボンドアジア通貨クラス受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定することを基本とします。 |                                                                                                                                   |  |
| 主な投資対象 | 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）<br>毎月分配型                                                                                                                                                                                                                                                                                           | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドグローバル・ハイ・イールド・ボンドアジア通貨クラス受益証券および野村マネー マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。 |  |
|        | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドグローバル・ハイ・イールド・ボンドアジア通貨クラス                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 世界のハイ・イールド債券を主要投資対象とします。                                                                                                          |  |
|        | 野村マネー マザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。                                                                                                         |  |
|        | 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）<br>毎月分配型                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行いません。                                                                                         |  |
| 主な投資制限 | 野村マネー マザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 株式への投資は行いません。                                                                                                                     |  |
| 分配方針   | 毎決算時に、原則として利子・配当等収益等を中心に安定分配を行なうことを基本とします。ただし、基準価額水準等によっては売買益等が中心となる場合や安定分配とならない場合があります。なお、毎年3月および9月の決算時には、安定分配相当額に委託者が決定する額を付加して分配する場合があります。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。「原則として、利子・配当等収益等を中心に安定分配を行なう」方針としていますが、これは、運用による収益が安定したものになることや基準価額が安定的に推移すること等を示唆するものではありません。                                                 |                                                                                                                                   |  |

### 野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104  
(受付時間) 営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近30期の運用実績

| 決 算 期             | 基 準<br>(分配落) | 価 額        |            |      | 債 券<br>組 入 比 率 | 債 券<br>先 物 比 率 | 投 資 信 託<br>組 入 比 率 | 純 資 産<br>総 額 |
|-------------------|--------------|------------|------------|------|----------------|----------------|--------------------|--------------|
|                   |              | 税 込<br>分 配 | み 金<br>騰 落 | 中 率  |                |                |                    |              |
|                   | 円            |            | 円          | %    | %              | %              | %                  | 百万円          |
| 119期(2020年4月15日)  | 4,932        |            | 50         | △3.7 | 0.0            | —              | 98.8               | 7,667        |
| 120期(2020年5月15日)  | 4,973        |            | 50         | 1.8  | 0.0            | —              | 99.1               | 7,713        |
| 121期(2020年6月15日)  | 5,356        |            | 50         | 8.7  | 0.0            | —              | 98.8               | 8,277        |
| 122期(2020年7月15日)  | 5,387        |            | 20         | 1.0  | 0.0            | —              | 98.2               | 8,291        |
| 123期(2020年8月17日)  | 5,513        |            | 20         | 2.7  | 0.0            | —              | 99.2               | 8,327        |
| 124期(2020年9月15日)  | 5,554        |            | 20         | 1.1  | 0.0            | —              | 99.0               | 8,265        |
| 125期(2020年10月15日) | 5,574        |            | 20         | 0.7  | 0.0            | —              | 98.9               | 8,039        |
| 126期(2020年11月16日) | 5,705        |            | 20         | 2.7  | 0.0            | —              | 99.2               | 8,085        |
| 127期(2020年12月15日) | 5,815        |            | 20         | 2.3  | 0.0            | —              | 99.2               | 7,987        |
| 128期(2021年1月15日)  | 5,884        |            | 20         | 1.5  | 0.0            | —              | 99.1               | 7,718        |
| 129期(2021年2月15日)  | 6,016        |            | 20         | 2.6  | 0.0            | —              | 99.0               | 7,759        |
| 130期(2021年3月15日)  | 6,098        |            | 20         | 1.7  | 0.0            | —              | 99.0               | 7,708        |
| 131期(2021年4月15日)  | 6,049        |            | 20         | △0.5 | 0.0            | —              | 99.0               | 7,474        |
| 132期(2021年5月17日)  | 6,242        |            | 20         | 3.5  | 0.0            | —              | 99.3               | 7,406        |
| 133期(2021年6月15日)  | 6,351        |            | 20         | 2.1  | 0.0            | —              | 98.8               | 7,418        |
| 134期(2021年7月15日)  | 6,302        |            | 20         | △0.5 | 0.0            | —              | 99.0               | 7,253        |
| 135期(2021年8月16日)  | 6,301        |            | 20         | 0.3  | 0.0            | —              | 98.7               | 7,139        |
| 136期(2021年9月15日)  | 6,387        |            | 20         | 1.7  | 0.0            | —              | 99.2               | 7,170        |
| 137期(2021年10月15日) | 6,458        |            | 20         | 1.4  | 0.0            | —              | 99.1               | 7,175        |
| 138期(2021年11月15日) | 6,527        |            | 20         | 1.4  | 0.0            | —              | 98.5               | 7,178        |
| 139期(2021年12月15日) | 6,434        |            | 20         | △1.1 | 0.0            | —              | 99.2               | 6,983        |
| 140期(2022年1月17日)  | 6,462        |            | 20         | 0.7  | 0.0            | —              | 99.1               | 6,953        |
| 141期(2022年2月15日)  | 6,299        |            | 20         | △2.2 | 0.0            | —              | 99.3               | 6,750        |
| 142期(2022年3月15日)  | 6,166        |            | 20         | △1.8 | 0.0            | —              | 98.8               | 6,576        |
| 143期(2022年4月15日)  | 6,581        |            | 20         | 7.1  | 0.0            | —              | 98.9               | 6,968        |
| 144期(2022年5月16日)  | 6,310        |            | 20         | △3.8 | 0.0            | —              | 99.1               | 6,656        |
| 145期(2022年6月15日)  | 6,375        |            | 20         | 1.3  | 0.0            | —              | 99.1               | 6,648        |
| 146期(2022年7月15日)  | 6,317        |            | 20         | △0.6 | 0.0            | —              | 98.9               | 6,549        |
| 147期(2022年8月15日)  | 6,451        |            | 20         | 2.4  | 0.0            | —              | 98.5               | 6,677        |
| 148期(2022年9月15日)  | 6,626        |            | 20         | 3.0  | 0.0            | —              | 98.9               | 6,790        |

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

\* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

| 決 算 期 | 年 月 日        | 基 準   | 価 額   | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 入 比 率 |
|-------|--------------|-------|-------|-----------|-----------|-----------------|
|       |              |       | 騰 落 率 |           |           |                 |
| 第143期 | (期 首)        | 円     | %     | %         | %         | %               |
|       | 2022年 3 月15日 | 6,166 | —     | 0.0       | —         | 98.8            |
|       | 3 月末         | 6,518 | 5.7   | 0.0       | —         | 99.2            |
|       | (期 末)        |       |       |           |           |                 |
| 第144期 | 2022年 4 月15日 | 6,601 | 7.1   | 0.0       | —         | 98.9            |
|       | (期 首)        |       |       |           |           |                 |
|       | 2022年 4 月15日 | 6,581 | —     | 0.0       | —         | 98.9            |
|       | 4 月末         | 6,552 | △0.4  | 0.0       | —         | 99.2            |
| 第145期 | (期 末)        |       |       |           |           |                 |
|       | 2022年 5 月16日 | 6,330 | △3.8  | 0.0       | —         | 99.1            |
|       | (期 首)        |       |       |           |           |                 |
|       | 2022年 5 月16日 | 6,310 | —     | 0.0       | —         | 99.1            |
| 第146期 | 5 月末         | 6,322 | 0.2   | 0.0       | —         | 99.3            |
|       | (期 末)        |       |       |           |           |                 |
|       | 2022年 6 月15日 | 6,395 | 1.3   | 0.0       | —         | 99.1            |
|       | (期 首)        |       |       |           |           |                 |
| 第147期 | 2022年 6 月15日 | 6,375 | —     | 0.0       | —         | 99.1            |
|       | 6 月末         | 6,302 | △1.1  | 0.0       | —         | 99.3            |
|       | (期 末)        |       |       |           |           |                 |
|       | 2022年 7 月15日 | 6,337 | △0.6  | 0.0       | —         | 98.9            |
| 第148期 | (期 首)        |       |       |           |           |                 |
|       | 2022年 7 月15日 | 6,317 | —     | 0.0       | —         | 98.9            |
|       | 7 月末         | 6,359 | 0.7   | 0.0       | —         | 99.0            |
|       | (期 末)        |       |       |           |           |                 |
| 第149期 | 2022年 8 月15日 | 6,471 | 2.4   | 0.0       | —         | 98.5            |
|       | (期 首)        |       |       |           |           |                 |
|       | 2022年 8 月15日 | 6,451 | —     | 0.0       | —         | 98.5            |
|       | 8 月末         | 6,482 | 0.5   | 0.0       | —         | 98.8            |
| 第150期 | (期 末)        |       |       |           |           |                 |
|       | 2022年 9 月15日 | 6,646 | 3.0   | 0.0       | —         | 98.9            |

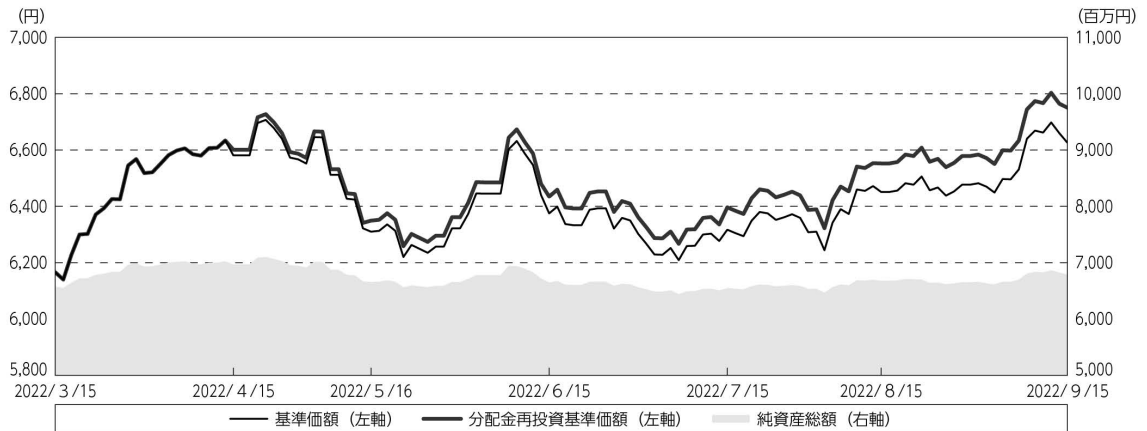
\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

\* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

## ○作成期間中の基準価額等の推移



第143期首：6,166円

第148期末：6,626円（既払分配金（税込み）：120円）

騰落率：9.5%（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（2022年3月15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。

## ○基準価額の主な変動要因

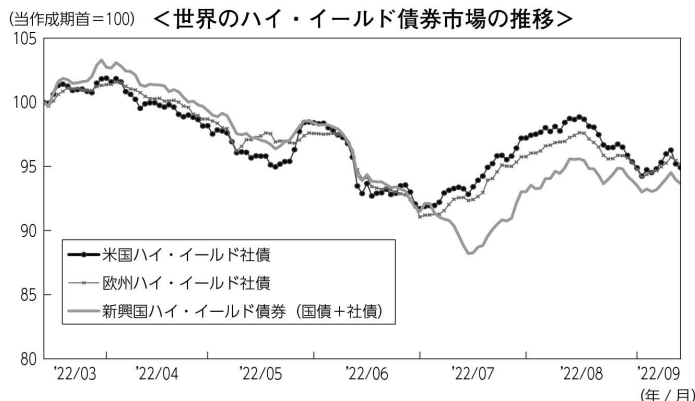
基準価額は、当作成期首6,166円から当作成期末には6,626円となりました。

- ・ 実質的に投資している世界のハイ・イールド債券からのインカムゲイン（利子収入）
- ・ 実質的に投資している世界のハイ・イールド債券からのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）
- ・ 円／アジア通貨（中国、インド、インドネシアの3カ国の通貨のバスケット）の為替変動

## ○投資環境

### <世界のハイ・イールド債券市場>

世界のハイ・イールド債券市場の騰落は以下のようになりました。



(注) 各市場指数の騰落は、当ファンドにおける組入資産の評価時点に合わせています。また、各市場指数は、米ドル建て指数を用いています。  
 米国ハイ・イールド社債：ICE BofA US High Yield Constrained Index、欧州ハイ・イールド社債：ICE BofA Euro High Yield Constrained Index、  
 新興国ハイ・イールド債券：JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル(BB格以下)とJPモルガン・コーポレート・  
 エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・ブロード(BB格以下)を半分ずつ合成し日割りバランスしたと仮定し算出。

### <米国ハイ・イールド債券市場>

当作成期首から、FRB（米連邦準備制度理事会）がインフレ抑制に向けて積極的な金融引き締めを行なうという警戒感から米長期金利が上昇したことなどを背景に下落しました。5月下旬、FOMC（米連邦公開市場委員会）議事要旨の内容が想定内にとどまったことなどからリスク選好的となり反発しましたが、6月は再び金融引き締めに対する警戒感から下落しました。7月に入り、米国株式市場のリバウンド（反発）によりリスクセンチメント（市場心理）が改善したことや、インフレがピークを越えたとの思惑からFRBによる利上げペースが緩やかになるとの見方が強まったことなどから上昇しましたが、8月下旬のジャクソンホール会議にてパウエルFRB議長がインフレ沈静化まで当面金融引き締めが必要であると強調したことなどを背景に米長期金利が上昇したことで下落し、当作成期間において値下がりとなりました。

### <欧州ハイ・イールド債券市場>

当作成期首から、ロシアによるウクライナ侵攻で高まる地政学的リスクやエネルギー価格上昇に伴うインフレ高進と欧州景気への影響が不安視されたことなどを背景に下落しました。6月は、ECB（欧州中央銀行）理事会が7月の利上げを示唆したことやSNB（スイス国立銀行）がインフレ抑制のために2007年以降の利上げに踏み切ったことなどを背景にグローバルに金融引き締めが進むとの警戒から下落基調となりました。7月以降は、欧州株式市場のリバウンドや良好な欧米企業決算によりリスクセンチメントが改善し景気後退懸念が薄れていったことなどをを受けて上昇しましたが、8月下旬にノルドストリーム1の一時停止を受け欧州の天然ガス価格が急騰しインフレ懸念が高まったこと、ジャクソンホール会議にてパウエルFRB議長

がインフレ沈静化まで当面金融引き締めが必要であると強調したことなどを背景に欧米長期金利が上昇したことで下落し、当作成期間において値下がりとなりました。

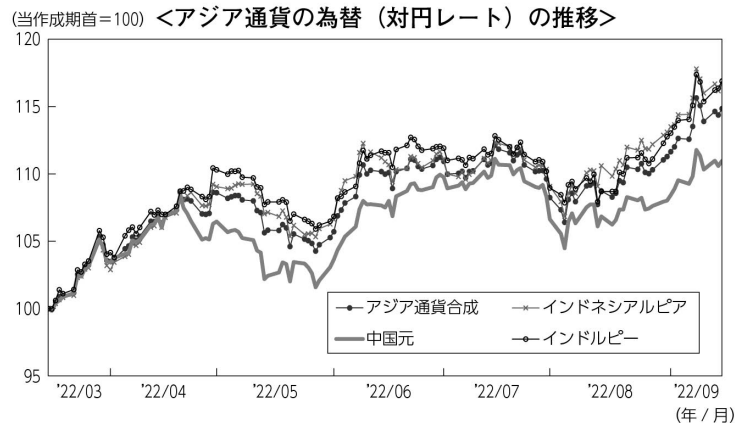
### <新興国ハイ・イールド債券市場>

当作成期首は、ウクライナとロシアの停戦交渉の進展への期待感から上昇しましたが、4月に入りFRBが積極的に金融引き締めを進めるとの観測から米長期金利が上昇したほか、新型コロナウイルス対策のため厳格な行動規制が続く中国で経済の減速懸念が強まったことなどから世界経済の先行き不透明感が意識されたことなどを背景に下落しました。6月に入っても、インフレ懸念を背景に欧米金利が上昇したことやロシアのドイツ向け天然ガス供給の停止が、景気減速への警戒感を強めたことなどから下落基調となりました。7月下旬にはリスクセンチメント改善で米国株式市場が上昇し、前年比ベースでの伸び率が鈍化した7月米CPI（消費者物価指数）を受けインフレがピークを越えたとの思惑から各国中銀による利上げペースが緩やかになるとの見方が強まったことなどを背景に上昇しましたが、当作成期間において値下がりとなりました。

- ICE BofA US High Yield Constrained Indexは、ICE Data Indices, LLCが算出する、米国のハイ・イールド・ボンド市場全体のパフォーマンスを表わす代表的な指数です。  
ICE BofA Euro High Yield Constrained Indexは、ICE Data Indices, LLCが算出する、欧州のハイ・イールド・ボンド市場全体のパフォーマンスを表わす代表的な指数です。
- JPモルガン・エマーシング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル（JP Morgan Emerging Market Bond Index Global）は、J.P.Morgan Securities LLCが公表しているエマーシング・マーケット国債を対象としたインデックスです。JPモルガン・コーポレート・エマーシング・マーケット・ボンド・インデックス・ブロード（JP Morgan Corporate Emerging Market Bond Index Broad）は、J.P.Morgan Securities LLCが公表しているエマーシング・マーケット社債を対象としたインデックスです。

### <為替レート>

アジア通貨（中国、インド、インドネシアの3カ国の通貨を等分投資し、日々リバランスを行なったと仮定したもの）の円に対する為替レートは以下のように推移いたしました。



(注) 為替レートは、当ファンドにおける組入資産の評価時点に合わせています。  
また、為替市場の推移はBloombergのデータを用いて計算しています。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### 〔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〕

〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンドーアジア通貨クラス〕 受益証券および〔野村マネー マザーファンド〕 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンドーアジア通貨クラス〕 受益証券への投資比率は、概ね高位を維持しました。

### 〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンドーアジア通貨クラス〕

主要投資対象である〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンド〕 のポートフォリオにおける信用格付け別比率については、当作成期末現在で、AAA格0.0%、AA格1.1%、A格3.5%、BBB格8.7%、BB格28.6%、B格34.1%、CCC格以下および無格付23.9%となりました。

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

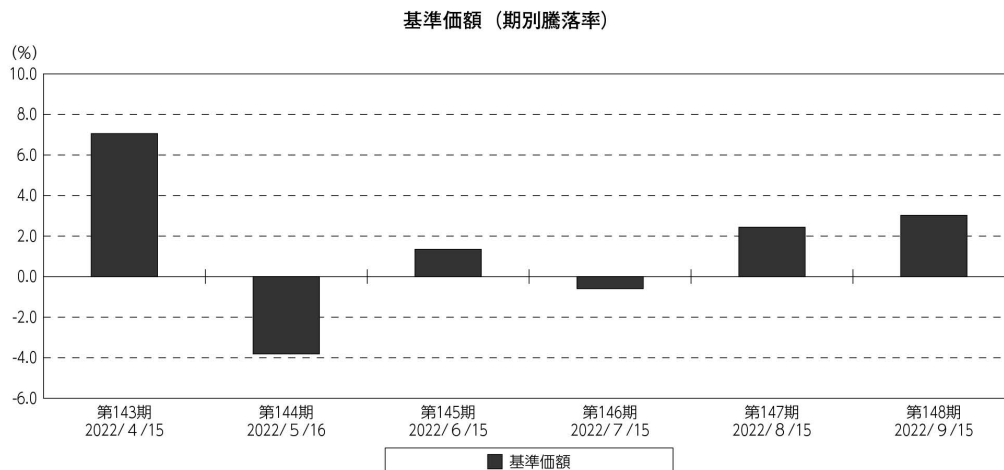
### 〔野村マネー マザーファンド〕

残存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。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、作成期間中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

## ◎分配金

収益分配については、期毎の分配原資の範囲内で、原則として、利子・配当等収益等を中心に分配を行ないました。

留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

## ○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

| 項 目                | 第143期                     | 第144期                     | 第145期                     | 第146期                     | 第147期                     | 第148期                     |
|--------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
|                    | 2022年3月16日～<br>2022年4月15日 | 2022年4月16日～<br>2022年5月16日 | 2022年5月17日～<br>2022年6月15日 | 2022年6月16日～<br>2022年7月15日 | 2022年7月16日～<br>2022年8月15日 | 2022年8月16日～<br>2022年9月15日 |
| 当期分配金<br>(対基準価額比率) | 20<br>0.303%              | 20<br>0.316%              | 20<br>0.313%              | 20<br>0.316%              | 20<br>0.309%              | 20<br>0.301%              |
| 当期の収益              | 20                        | 20                        | 20                        | 20                        | 20                        | 20                        |
| 当期の収益以外            | —                         | —                         | —                         | —                         | —                         | —                         |
| 翌期繰越分配対象額          | 4,085                     | 4,094                     | 4,107                     | 4,117                     | 4,131                     | 4,145                     |

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

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

## ◎今後の運用方針

### 【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】

〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンドーアジア通貨クラス〕受益証券および〔野村マネー マザーファンド〕受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする〔ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンドーアジア通貨クラス〕受益証券への投資比率を高位で維持することを目指します。

### 【ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンドーアジア通貨クラス】

世界のハイ・イールド債券を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目指します。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、アジア通貨（中国、インド、インドネシアの3カ国の通貨のバスケット）を買う為替取引を行ないます。

債券への投資にあたっては、引き続き、高水準のインカムゲイン（利子収入）の確保とキャピタルゲイン（値上がり益）の獲得を目指し、地域別配分、信用格付別配分、債券種別配分に考慮したポートフォリオの構築を行なっています。地域間の市場環境や利回り水準などに鑑み、相対的に利回り水準が高く、中長期的な観点から、潜在的に高いリターンが見込まれる地域への投資を高位とする戦略を継続する方針です。また、ファンダメンタルズ（基礎的条件）が概ね良好と判断する社債への投資比率を、相対的に高位とする戦略を継続する方針です。

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。

日本銀行によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご留意ください。

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。

※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受け、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。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年 3 月16日～2022年 9 月15日)

| 項 目                    | 第143期～第148期 |            | 項 目 の 概 要                                    |
|------------------------|-------------|------------|----------------------------------------------|
|                        | 金 額         | 比 率        |                                              |
| (a) 信 託 報 酬            | 円<br>28     | %<br>0.433 | (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 )            | (10)        | (0.152)    | 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 )            | (17)        | (0.266)    | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等 |
| ( 受 託 会 社 )            | ( 1 )       | (0.014)    | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等                  |
| (b) そ の 他 費 用          | 0           | 0.001      | (b)その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数             |
| ( 監 査 費 用 )            | ( 0 )       | (0.001)    | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用                  |
| 合 計                    | 28          | 0.434      |                                              |
| 作成期間の平均基準価額は、6,422円です。 |             |            |                                              |

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

\* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\* その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

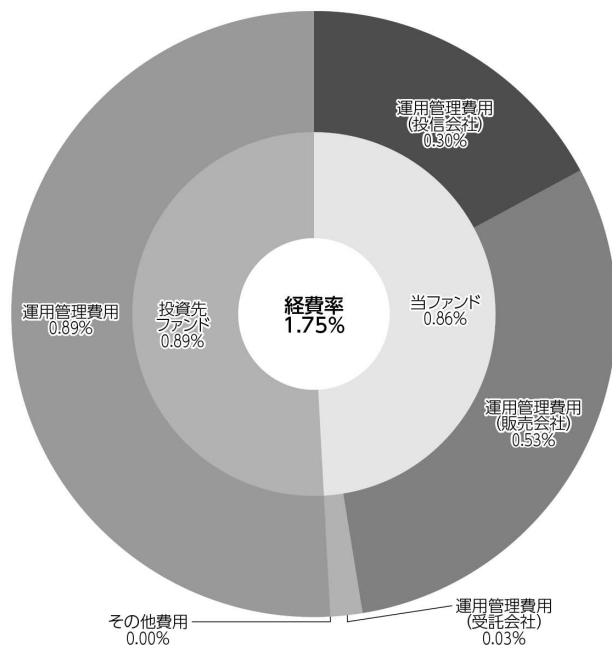
\* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

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

## （参考情報）

## ○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

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経費率（年率）は1.75%です。



(単位：%)

|                    |      |
|--------------------|------|
| 経費率 (①+②)          | 1.75 |
| ①当ファンドの費用の比率       | 0.86 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.89 |

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（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) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(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。

○売買及び取引の状況

(2022年3月16日～2022年9月15日)

投資信託証券

| 銘柄 |                                                     | 第143期～第148期 |         |             |               |
|----|-----------------------------------------------------|-------------|---------|-------------|---------------|
|    |                                                     | 買付          |         | 売付          |               |
|    |                                                     | 口数          | 金額      | 口数          | 金額            |
| 国内 | ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドー<br>グローバル・ハイ・イールド・ボンドーアジア通貨クラス | 口<br>—      | 千円<br>— | 口<br>54,885 | 千円<br>202,360 |

\*金額は受け渡し代金。  
\*金額の単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2022年3月16日～2022年9月15日)

利害関係人との取引状況

＜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＞  
該当事項はございません。

＜野村マネー マザーファンド＞

| 区分  | 第143期～第148期  |                    |               |           |                    |               |
|-----|--------------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|     | 買付額等<br>A    | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 公社債 | 百万円<br>6,430 | 百万円<br>30          | %<br>0.5      | 百万円<br>—  | 百万円<br>—           | %<br>—        |

平均保有割合 0.0%

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

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

○組入資産の明細

(2022年9月15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142期末         | 第148期末         |                 |           |
|-----------------------------------------------------|----------------|----------------|-----------------|-----------|
|                                                     | 口数             | 口数             | 評価額             | 比率        |
| ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドー<br>グローバル・ハイ・イールド・ボンドーアジア通貨クラス | 口<br>1,829,139 | 口<br>1,774,254 | 千円<br>6,717,325 | %<br>98.9 |
| 合計                                                  | 1,829,139      | 1,774,254      | 6,717,325       | 98.9      |

\*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。  
\*評価額の単位未満は切り捨て。

## 親投資信託残高

| 銘             | 柄 | 第142期末    | 第148期末    |             |
|---------------|---|-----------|-----------|-------------|
|               |   | 口数        | 口数        | 評価額         |
| 野村マネー マザーファンド |   | 千口<br>984 | 千口<br>984 | 千円<br>1,004 |

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2022年9月15日現在)

| 項 目           | 第148期末          |           |
|---------------|-----------------|-----------|
|               | 評 価 額           | 比 率       |
| 投資信託受益証券      | 千円<br>6,717,325 | %<br>98.5 |
| 野村マネー マザーファンド | 1,004           | 0.0       |
| コール・ローン等、その他  | 99,708          | 1.5       |
| 投資信託財産総額      | 6,818,037       | 100.0     |

\*金額の単位未満は切り捨て。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目                | 第143期末          | 第144期末          | 第145期末          | 第146期末          | 第147期末          | 第148期末          |
|--------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
|                    | 2022年4月15日現在    | 2022年5月16日現在    | 2022年6月15日現在    | 2022年7月15日現在    | 2022年8月15日現在    | 2022年9月15日現在    |
|                    | 円               | 円               | 円               | 円               | 円               | 円               |
| (A) 資産             | 6,998,238,549   | 6,687,573,293   | 6,696,052,671   | 6,579,565,468   | 6,704,985,273   | 6,818,037,908   |
| コール・ローン等           | 104,978,704     | 90,813,219      | 105,307,559     | 102,360,536     | 125,570,597     | 99,707,832      |
| 投資信託受益証券(評価額)      | 6,892,255,413   | 6,595,755,642   | 6,589,740,680   | 6,476,200,500   | 6,578,410,244   | 6,717,325,644   |
| 野村マネー マザーファンド(評価額) | 1,004,432       | 1,004,432       | 1,004,432       | 1,004,432       | 1,004,432       | 1,004,432       |
| (B) 負債             | 30,039,343      | 30,805,238      | 47,816,418      | 30,515,286      | 27,192,193      | 27,358,191      |
| 未払収益分配金            | 21,175,836      | 21,099,070      | 20,857,408      | 20,733,223      | 20,701,944      | 20,498,392      |
| 未払解約金              | 3,844,517       | 4,632,913       | 22,215,191      | 5,135,754       | 1,670,213       | 1,964,925       |
| 未払信託報酬             | 5,006,137       | 5,060,254       | 4,731,655       | 4,634,407       | 4,807,694       | 4,882,282       |
| 未払利息               | 29              | 33              | 43              | 29              | 25              | 86              |
| その他未払費用            | 12,824          | 12,968          | 12,121          | 11,873          | 12,317          | 12,506          |
| (C) 純資産総額(A－B)     | 6,968,199,206   | 6,656,768,055   | 6,648,236,253   | 6,549,050,182   | 6,677,793,080   | 6,790,679,717   |
| 元本                 | 10,587,918,380  | 10,549,535,003  | 10,428,704,233  | 10,366,611,837  | 10,350,972,094  | 10,249,196,254  |
| 次期繰越損益金            | △ 3,619,719,174 | △ 3,892,766,948 | △ 3,780,467,980 | △ 3,817,561,655 | △ 3,673,179,014 | △ 3,458,516,537 |
| (D) 受益権総口数         | 10,587,918,380口 | 10,549,535,003口 | 10,428,704,233口 | 10,366,611,837口 | 10,350,972,094口 | 10,249,196,254口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D)    | 6,581円          | 6,310円          | 6,375円          | 6,317円          | 6,451円          | 6,626円          |

(注) 第143期首元本額は10,665,171,748円、第143～148期中追加設定元本額は30,424,256円、第143～148期中一部解約元本額は446,399,750円、1口当たり純資産額は、第143期0.6581円、第144期0.6310円、第145期0.6375円、第146期0.6317円、第147期0.6451円、第148期0.6626円です。

## ○損益の状況

| 項 目               | 第143期                     | 第144期                     | 第145期                     | 第146期                     | 第147期                     | 第148期                     |
|-------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
|                   | 2022年3月16日～<br>2022年4月15日 | 2022年4月16日～<br>2022年5月16日 | 2022年5月17日～<br>2022年6月15日 | 2022年6月16日～<br>2022年7月15日 | 2022年7月16日～<br>2022年8月15日 | 2022年8月16日～<br>2022年9月15日 |
|                   | 円                         | 円                         | 円                         | 円                         | 円                         | 円                         |
| (A) 配当等収益         | 36,435,718                | 36,357,841                | 35,955,623                | 35,764,176                | 35,637,103                | 35,462,390                |
| 受取配当金             | 36,436,065                | 36,358,567                | 35,956,461                | 35,765,167                | 35,637,789                | 35,464,153                |
| 支払利息              | △ 347                     | △ 726                     | △ 838                     | △ 991                     | △ 686                     | △ 1,763                   |
| (B) 有価証券売買損益      | 429,005,341               | △ 296,436,689             | 57,143,421                | △ 70,108,316              | 128,470,516               | 168,277,770               |
| 売買益               | 431,576,159               | 160,885                   | 59,464,937                | 625,833                   | 128,535,520               | 168,622,101               |
| 売買損               | △ 2,570,818               | △ 296,597,574             | △ 2,321,516               | △ 70,734,149              | △ 65,004                  | △ 344,331                 |
| (C) 信託報酬等         | △ 5,018,961               | △ 5,073,222               | △ 4,743,776               | △ 4,646,280               | △ 4,820,011               | △ 4,894,788               |
| (D) 当期繰越益金(A+B+C) | 460,422,098               | △ 265,152,070             | 88,355,268                | △ 38,990,420              | 159,287,608               | 198,845,372               |
| (E) 前期繰越損益金       | △1,590,024,352            | △1,145,996,591            | △1,414,939,278            | △1,338,649,325            | △1,395,542,638            | △1,243,782,430            |
| (F) 追加信託差損益金      | △2,468,941,084            | △2,460,519,217            | △2,433,026,562            | △2,419,188,687            | △2,416,222,040            | △2,393,081,087            |
| (配当等相当額)          | ( 2,238,060,638)          | ( 2,230,904,981)          | ( 2,206,359,869)          | ( 2,194,221,996)          | ( 2,191,924,731)          | ( 2,171,394,766)          |
| (売買損益相当額)         | (△4,707,001,722)          | (△4,691,424,198)          | (△4,639,386,431)          | (△4,613,410,683)          | (△4,608,146,771)          | (△4,564,475,853)          |
| (G) 計(D+E+F)      | △3,598,543,338            | △3,871,667,878            | △3,759,610,572            | △3,796,828,432            | △3,652,477,070            | △3,438,018,145            |
| (H) 収益分配金         | △ 21,175,836              | △ 21,099,070              | △ 20,857,408              | △ 20,733,223              | △ 20,701,944              | △ 20,498,392              |
| 次期繰越損益金(G+H)      | △3,619,719,174            | △3,892,766,948            | △3,780,467,980            | △3,817,561,655            | △3,673,179,014            | △3,458,516,537            |
| 追加信託差損益金          | △2,468,941,084            | △2,460,519,217            | △2,433,026,562            | △2,419,188,687            | △2,416,222,040            | △2,393,081,087            |
| (配当等相当額)          | ( 2,238,060,638)          | ( 2,230,904,981)          | ( 2,206,359,869)          | ( 2,194,221,996)          | ( 2,191,924,731)          | ( 2,171,394,766)          |
| (売買損益相当額)         | (△4,707,001,722)          | (△4,691,424,198)          | (△4,639,386,431)          | (△4,613,410,683)          | (△4,608,146,771)          | (△4,564,475,853)          |
| 分配準備積立金           | 2,087,231,467             | 2,088,974,716             | 2,077,521,749             | 2,074,659,912             | 2,084,443,209             | 2,077,237,077             |
| 繰越損益金             | △3,238,009,557            | △3,521,222,447            | △3,424,963,167            | △3,473,032,880            | △3,341,400,183            | △3,142,672,527            |

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

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

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

(注) 分配金の計算過程(2022年3月16日～2022年9月15日)は以下の通りです。

| 項 目                          | 第143期                     | 第144期                     | 第145期                     | 第146期                     | 第147期                     | 第148期                     |
|------------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
|                              | 2022年3月16日～<br>2022年4月15日 | 2022年4月16日～<br>2022年5月16日 | 2022年5月17日～<br>2022年6月15日 | 2022年6月16日～<br>2022年7月15日 | 2022年7月16日～<br>2022年8月15日 | 2022年8月16日～<br>2022年9月15日 |
| a. 配当等収益(経費控除後)              | 36,042,992円               | 31,284,939円               | 34,123,947円               | 31,118,241円               | 34,590,494円               | 34,610,556円               |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越大損金補填後) | 0円                        | 0円                        | 0円                        | 0円                        | 0円                        | 0円                        |
| c. 信託約款に定める収益調整金             | 2,238,060,638円            | 2,230,904,981円            | 2,206,359,869円            | 2,194,221,996円            | 2,191,924,731円            | 2,171,394,766円            |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金           | 2,072,364,311円            | 2,078,788,847円            | 2,064,255,210円            | 2,064,274,894円            | 2,070,554,659円            | 2,063,124,913円            |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d)           | 4,346,467,941円            | 4,340,978,767円            | 4,304,739,026円            | 4,289,615,131円            | 4,297,069,884円            | 4,269,130,235円            |
| f. 分配対象収益(1万円当たり)            | 4,105円                    | 4,114円                    | 4,127円                    | 4,137円                    | 4,151円                    | 4,165円                    |
| g. 分配金                       | 21,175,836円               | 21,099,070円               | 20,857,408円               | 20,733,223円               | 20,701,944円               | 20,498,392円               |
| h. 分配金(1万円当たり)               | 20円                       | 20円                       | 20円                       | 20円                       | 20円                       | 20円                       |

○分配金のお知らせ

|                 | 第143期 | 第144期 | 第145期 | 第146期 | 第147期 | 第148期 |
|-----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 1 万口当たり分配金（税込み） | 20円   | 20円   | 20円   | 20円   | 20円   | 20円   |

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。  
※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。  
※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

Nomura Multi Managers Fund — Global High Yield Bond

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンド

2021年6月30日決算

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                       |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|--------|--------|----------------------------|----|----|----------|-----------------------------------------------------------------------------------|--------|--------|----------|------------------------------------------------------------------------------|--|--|
| 形 態                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | ケイマン諸島籍円建て外国投資信託                                                                                                                                                                                                                      |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
| 投 資 目 的                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | ◆世界のハイ・イールド債券を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を図ることを目指します。<br>◆投資顧問会社が、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、ハイ・イールド債券の運用を行なう運用会社を原則として複数選定します。<br>◆「ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンド」には、為替取引手法の異なる3つのクラス(日本円クラス、資源国通貨クラス、アジア通貨クラス)があります。 |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
| 投 資 態 度                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | ●ハイ・イールド債券を、発行体の登録国や所在地、発行通貨等から、「米国」、「欧州」、「新興国その他」の各地域に属する債券に分類します。<br>●各地域の債券への投資比率は、原則として、下表の通りとします。                                                                                                                                |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | <table><tr><td>地域名</td><td>米国</td><td>欧州</td><td>新興国その他</td></tr><tr><td>投資比率</td><td>25-50%</td><td>25-50%</td><td>25-50%</td></tr></table>                                                                                          |        |        |        | 地域名                        | 米国 | 欧州 | 新興国その他   | 投資比率                                                                              | 25-50% | 25-50% | 25-50%   |                                                                              |  |  |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 地域名                                                                                                                                                                                                                                   | 米国     | 欧州     | 新興国その他 |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 投資比率                                                                                                                                                                                                                                  | 25-50% | 25-50% | 25-50% |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | ※上記の投資比率は、市場構造や投資環境の変化等によって、見直す場合があります。                                                                                                                                                                                               |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | ●米ドル建て以外外貨建資産に投資を行なった場合は、各副投資顧問会社が、原則として当該資産にかかる通貨を売り、米ドルを買う為替取引を行ないます。                                                                                                                                                               |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | ●株式への投資は優先証券のうち株券または新株引受権証書の性質を有するものまたは転換社債を転換および新株予約権を行使したものならびに社債権者割当等により取得したものに限り、株式への投資割合はファンドの純資産総額の30%以内とします。                                                                                                                   |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | ●格付をもたない債券(国債・地方債等は除く)への投資割合は、取得時において、原則としてファンドの純資産総額の10%以内とします。                                                                                                                                                                      |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | ●CCC+格(S&P社)以下またはCaa 1格(Moody's社)以下の格付の債券(ディストレス債およびデフォルト債を含みます。)への投資割合は、取得時において、原則としてファンドの純資産総額の30%以内とします。                                                                                                                           |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | ●外貨建資産については、クラスごとに以下のとおり為替取引を行ないます。                                                                                                                                                                                                   |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
| <table><tr><td>円クラス</td><td colspan="3">外貨建資産を原則として対円で為替ヘッジを行ないます。</td></tr><tr><td>資源国通貨クラス</td><td colspan="3">外貨建資産を原則として、実質的に当該資産に係る通貨を売り、資源国通貨(ブラジル、オーストラリア、南アフリカの3カ国の通貨のバスケット)を買う為替取引を行ないます。</td></tr><tr><td>アジア通貨クラス</td><td colspan="3">外貨建資産を原則として、実質的に当該資産に係る通貨を売り、アジア通貨(中国、インド、インドネシアの3カ国の通貨のバスケット)を買う為替取引を行ないます。</td></tr></table> |                                                                                                                                                                                                                                       |        |        | 円クラス   | 外貨建資産を原則として対円で為替ヘッジを行ないます。 |    |    | 資源国通貨クラス | 外貨建資産を原則として、実質的に当該資産に係る通貨を売り、資源国通貨(ブラジル、オーストラリア、南アフリカの3カ国の通貨のバスケット)を買う為替取引を行ないます。 |        |        | アジア通貨クラス | 外貨建資産を原則として、実質的に当該資産に係る通貨を売り、アジア通貨(中国、インド、インドネシアの3カ国の通貨のバスケット)を買う為替取引を行ないます。 |  |  |
| 円クラス                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 外貨建資産を原則として対円で為替ヘッジを行ないます。                                                                                                                                                                                                            |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
| 資源国通貨クラス                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 外貨建資産を原則として、実質的に当該資産に係る通貨を売り、資源国通貨(ブラジル、オーストラリア、南アフリカの3カ国の通貨のバスケット)を買う為替取引を行ないます。                                                                                                                                                     |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
| アジア通貨クラス                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 外貨建資産を原則として、実質的に当該資産に係る通貨を売り、アジア通貨(中国、インド、インドネシアの3カ国の通貨のバスケット)を買う為替取引を行ないます。                                                                                                                                                          |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
| ●投資顧問会社が、ハイ・イールド債券の運用を行なう副投資顧問会社の選定と、各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率を決定します。                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                       |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
| ●副投資顧問会社の選定にあたっては、運用体制や運用プロセスなどに対する独自の定性評価を重視し、ハイ・イールド債券の運用において優れていると判断した運用会社を原則として複数選定します。                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                                                                                                                                       |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
| ●投資顧問会社は選定した副投資顧問会社及びファンド全体のリスク特性の状況を絶えずモニターし、必要に応じて各副投資顧問会社が運用する信託財産の配分比率の変更や副投資顧問会社の入替を適宜行ないます。                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                       |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
| ●資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                       |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
| 受 託 会 社                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー                                                                                                                                                                                                                 |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
| 投 資 顧 問 会 社                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 野村アセットマネジメント株式会社                                                                                                                                                                                                                      |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
| 管理事務代行会社                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                                                                                                                                                                                                                                       |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |
| 保 管 銀 行                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | ノムラ・バンク(ルクセンブルグ)エス・エー                                                                                                                                                                                                                 |        |        |        |                            |    |    |          |                                                                                   |        |        |          |                                                                              |  |  |

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

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

「副投資顧問会社は、米国1940年投資顧問法規則第206条(4)項2号(「カस्ट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副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。

副投資顧問会社は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。」

**純資産計算書**  
**2021年6月30日現在**  
*(金額は米ドル表示)*

|                           |             |
|---------------------------|-------------|
| 資産                        |             |
| 投資有価証券時価                  | 483,603,198 |
| (取得原価: 481,920,331米ドル)    |             |
| 現金預金等                     | 53,440,220  |
| クレジット・デフォルト・スワップ契約に係る評価差益 | 14,141      |
| デリバティブに係る委託証拠金            | 292,389     |
| ブローカーからの未収金               | 2,543,163   |
| 未収収益                      | 6,618,934   |
| 資産合計                      | 546,512,045 |
| 負債                        |             |
| 銀行借越金                     | 4,830,000   |
| 先物契約に係る評価差損               | 85,855      |
| 外国為替先渡し契約に係る評価差損          | 1,896,882   |
| 受益証券買戻支払金                 | 2,501,104   |
| ブローカーへの未払金                | 8,451,643   |
| 未払費用                      | 1,236,027   |
| 未払利息                      | 19          |
| 負債合計                      | 19,001,530  |
| 純資産総額                     | 527,510,515 |

**受益証券一口当たり情報:**

|             | 1口当たり純資産価格 | 発行済受益証券数   | 純資産総額          |
|-------------|------------|------------|----------------|
| 日本円クラス(円)   | 5,563      | 1,383,611  | 7,696,457,656  |
| アジア通貨クラス(円) | 3,688      | 2,219,733  | 8,186,528,280  |
| 資源国通貨クラス(円) | 2,096      | 20,240,341 | 42,430,719,294 |

**運用計算書**  
**2021年6月30日に終了する計測期間**  
*(金額は米ドル表示)*

|                              |             |
|------------------------------|-------------|
| 収益                           |             |
| 債券利息(源泉徴収税控除後)               | 25,245,798  |
| 受取配当金等(源泉徴収税控除後)             | 56,944      |
| 雑収益                          | 109         |
| 収益合計                         | 25,302,851  |
| 費用                           |             |
| 投資顧問報酬                       | 4,139,261   |
| 事務管理代行報酬                     | 458,291     |
| 保管費用                         | 151,809     |
| 銀行口座に係る支払利息                  | 10,805      |
| 取引銀行報酬                       | 47,748      |
| 銀行手数料                        | 52,200      |
| 受託報酬                         | 107,932     |
| 法務報酬                         | 4,528       |
| 立替費用                         | 53,904      |
| 専門家報酬                        | 75,823      |
| 印刷、出版手数料                     | 5,953       |
| 雑費用                          | 41,287      |
| 費用合計                         | 5,149,541   |
| 純投資損益                        | 20,153,310  |
| 投資有価証券売買に係る損益                | 13,713,962  |
| 先物契約に係る損益                    | 166,518     |
| 外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益        | 44,099,115  |
| クレジット・デフォルト・スワップ契約に係る損益      | 34,663      |
| 当期実現純損益                      | 58,014,258  |
| 投資有価証券評価損益の増減                | 39,219,188  |
| 先物契約に係る評価損益の増減               | (9,227)     |
| クレジット・デフォルト・スワップ契約に係る評価損益の増減 | (133,406)   |
| 外国為替先渡し契約に係る評価損益の増減          | 3,341,143   |
| 当期評価差損益                      | 42,417,698  |
| 運用の結果による純資産の増減額              | 120,585,266 |

**純資産変動計算書**  
**2021年6月30日に終了する計測期間**  
*(金額は米ドル表示)*

|                 |               |
|-----------------|---------------|
| 期首純資産総額         | 531,495,583   |
| 純投資損益           | 20,153,310    |
| 当期実現純損益         | 58,014,258    |
| 当期評価差損益         | 42,417,698    |
| 運用の結果による純資産の増減額 | 120,585,266   |
| 受益証券の発行手取金      | 13,341,072    |
| 受益証券の買戻支払金      | (102,593,300) |
|                 | (89,252,228)  |
| 受益者への支払分配金      | (35,318,106)  |
| 期末純資産総額         | 527,510,515   |

**発行済受益証券数の変動表**  
**2021年6月30日に終了する計測期間**  
*(未監査)*

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 日本円クラス     |                   |
| 期首受益証券数    | 1,485,385         |
| 発行受益証券数    | 132,635           |
| 買戻受益証券数    | (234,409)         |
| 期末発行済受益証券数 | <u>1,383,611</u>  |
| アジア通貨クラス   |                   |
| 期首受益証券数    | 2,982,293         |
| 発行受益証券数    | 55,448            |
| 買戻受益証券数    | (818,008)         |
| 期末発行済受益証券数 | <u>2,219,733</u>  |
| 資源国通貨クラス   |                   |
| 期首受益証券数    | 23,658,789        |
| 発行受益証券数    | 276,377           |
| 買戻受益証券数    | (3,694,825)       |
| 期末発行済受益証券数 | <u>20,240,341</u> |

**統計情報**  
**2021年6月30日現在**  
*(未監査)*

|              | 2021           | 2020           | 2019           |
|--------------|----------------|----------------|----------------|
| 期末純資産総額(米ドル) | 527,510,515    | 531,495,583    | 745,683,325    |
| 日本円クラス(円)    |                |                |                |
| 期末純資産総額      | 7,696,457,656  | 7,865,733,468  | 9,462,826,413  |
| 期末1口当たり純資産価格 | 5,563          | 5,295          | 5,853          |
| アジア通貨クラス(円)  |                |                |                |
| 期末純資産総額      | 8,186,528,280  | 9,540,533,693  | 10,316,818,974 |
| 期末1口当たり純資産価格 | 3,688          | 3,199          | 3,773          |
| 資源国通貨クラス(円)  |                |                |                |
| 期末純資産総額      | 42,430,719,294 | 39,849,122,160 | 60,489,472,706 |
| 期末1口当たり純資産価格 | 2,096          | 1,684          | 2,313          |

**組入資産明細**  
**2021年6月30日現在**  
(金額は米ドル表示)

| 通貨                 | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価             | 評価金額             | 純資産比率(%)    |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------------|------------------|-------------|
| <b>アンゴラ</b>        |                            |                                     |                  |                  |             |
| <b>国債</b>          |                            |                                     |                  |                  |             |
| USD                | 400,000                    | ANGOLA REP OF 8.2500% 09/05/28 REGS | 385,776          | 417,002          | 0.08        |
| USD                | 400,000                    | ANGOLA REP OF 9.1250% 26/11/49 REGS | 325,000          | 409,032          | 0.08        |
| USD                | 226,000                    | ANGOLA REP OF 9.3750% 08/05/48 REGS | 235,718          | 235,883          | 0.04        |
|                    |                            |                                     | <u>946,494</u>   | <u>1,061,917</u> | <u>0.20</u> |
|                    |                            | 合計：アンゴラ                             | <u>946,494</u>   | <u>1,061,917</u> | <u>0.20</u> |
| <b>アルゼンチン</b>      |                            |                                     |                  |                  |             |
| <b>国債</b>          |                            |                                     |                  |                  |             |
| USD                | 3,348,805                  | ARGENTINA 1.1250% 09/07/35          | 2,066,014        | 1,059,059        | 0.20        |
| USD                | 1,156,114                  | ARGENTINA 0.5000% 09/07/30          | 601,652          | 413,253          | 0.08        |
| USD                | 287,998                    | ARGENTINA 1.0000% 09/07/29          | 219,377          | 109,079          | 0.02        |
| USD                | 233,392                    | ARGENTINA 2.5000% 09/07/41          | 141,679          | 83,146           | 0.02        |
| USD                | 151,420                    | ARGENTINA 2.0000% 09/01/38          | 116,462          | 56,972           | 0.01        |
| USD                | 165,000                    | ARGENTINA 1.1250% 09/07/46          | 57,750           | 52,800           | 0.01        |
|                    |                            |                                     | <u>3,202,934</u> | <u>1,774,309</u> | <u>0.34</u> |
| <b>その他債券</b>       |                            |                                     |                  |                  |             |
| USD                | 300,000                    | PAN AMERICAN 9.1250% 30/04/27 REGS  | 300,000          | 329,253          | 0.06        |
| USD                | 150,000                    | YPF SOCIEDAD 8.7500% 04/04/24 REGS  | 146,426          | 133,185          | 0.03        |
|                    |                            |                                     | <u>446,426</u>   | <u>462,438</u>   | <u>0.09</u> |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |                  |                  |             |
| USD                | 300,000                    | GENNEIA SA 8.75% 20/01/22 REGS      | 313,470          | 290,250          | 0.05        |
| USD                | 350,000                    | YPF SOCIEDAD 6.9500% 21/07/27 REGS  | 267,750          | 246,750          | 0.04        |
| USD                | 150,000                    | YPF ENERGIA 10.0000% 25/07/26 REGS  | 148,158          | 132,750          | 0.03        |
| USD                | 100,000                    | YPF SOCIEDAD 8.5% 28/07/25 REGS     | 99,113           | 79,250           | 0.02        |
|                    |                            |                                     | <u>828,491</u>   | <u>749,000</u>   | <u>0.14</u> |
|                    |                            | 合計：アルゼンチン                           | <u>4,477,851</u> | <u>2,985,747</u> | <u>0.57</u> |
| <b>オーストラリア</b>     |                            |                                     |                  |                  |             |
| <b>その他債券</b>       |                            |                                     |                  |                  |             |
| USD                | 2,175,000                  | MIDWEST VANADIUM 11.5% 15/02/18 144 | 2,065,898        | 2,028            | 0.00        |
|                    |                            |                                     | <u>2,065,898</u> | <u>2,028</u>     | <u>0.00</u> |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |                  |                  |             |
| USD                | 235,000                    | FMG RES AUG 2 4.3750% 01/04/31 144A | 235,000          | 250,862          | 0.05        |
| USD                | 75,000                     | VIRGIN AU HLD 0.0000% 15/11/24 144A | 75,000           | 6,938            | 0.00        |
|                    |                            |                                     | <u>310,000</u>   | <u>257,800</u>   | <u>0.05</u> |
|                    |                            | 合計：オーストラリア                          | <u>2,375,898</u> | <u>259,828</u>   | <u>0.05</u> |
| <b>オーストリア</b>      |                            |                                     |                  |                  |             |
| <b>転換社債</b>        |                            |                                     |                  |                  |             |
| EUR                | 300,000                    | AMS AG CV 2.1250% 03/11/27          | 370,418          | 352,325          | 0.07        |
|                    |                            |                                     | <u>370,418</u>   | <u>352,325</u>   | <u>0.07</u> |
| <b>変動金利債</b>       |                            |                                     |                  |                  |             |
| EUR                | 200,000                    | LENZING AG FRN 07/12/69             | 239,410          | 253,010          | 0.05        |
|                    |                            |                                     | <u>239,410</u>   | <u>253,010</u>   | <u>0.05</u> |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |                  |                  |             |
| EUR                | 1,002,000                  | AMS AG 6.0000% 31/07/25 REGS        | 1,143,424        | 1,276,551        | 0.24        |
| USD                | 650,000                    | SUZANO AUSTRIA 3.1250% 15/01/32     | 641,076          | 643,305          | 0.12        |
| USD                | 300,000                    | SUZANO AUSTRI 7.0000% 16/03/47 REGS | 387,690          | 405,690          | 0.08        |
| USD                | 310,000                    | JBS USA FOOD 5.7500% 15/01/28 REGS  | 307,777          | 332,543          | 0.06        |
| USD                | 250,000                    | SUZANO AUSTRIA 5.0000% 15/01/30     | 277,563          | 283,250          | 0.05        |
| USD                | 200,000                    | SUZANO AUSTRIA 6.0000% 15/01/29     | 234,750          | 238,102          | 0.05        |
| USD                | 200,000                    | AMS AG 7.0000% 31/07/25 144A        | 198,000          | 215,500          | 0.04        |
| USD                | 200,000                    | JBS USA FOOD 7.0000% 15/01/26 144A  | 203,000          | 212,500          | 0.04        |
| USD                | 200,000                    | KLABIN AUSTRI 3.2000% 12/01/31 REGS | 200,000          | 196,228          | 0.04        |
|                    |                            |                                     | <u>3,593,280</u> | <u>3,803,669</u> | <u>0.72</u> |
|                    |                            | 合計：オーストリア                           | <u>4,203,108</u> | <u>4,409,004</u> | <u>0.84</u> |

| 通貨              | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価      | 評価金額      | 純資産比率(%) |
|-----------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|----------|
| <b>アゼルバイジャン</b> |                            |                                     |           |           |          |
| 普通社債(固定金利債)     |                            |                                     |           |           |          |
| USD             | 200,000                    | STATE OIL CO AZE 6.9500% 18/03/30   | 223,377   | 251,772   | 0.05     |
|                 |                            | 合計：アゼルバイジャン                         | 223,377   | 251,772   | 0.05     |
|                 |                            |                                     | 223,377   | 251,772   | 0.05     |
| <b>バハマ</b>      |                            |                                     |           |           |          |
| 普通社債(固定金利債)     |                            |                                     |           |           |          |
| USD             | 200,000                    | INTERCORP PER 3.8750% 15/08/29 REGS | 209,900   | 193,600   | 0.04     |
|                 |                            | 合計：バハマ                              | 209,900   | 193,600   | 0.04     |
|                 |                            |                                     | 209,900   | 193,600   | 0.04     |
| <b>バーレーン</b>    |                            |                                     |           |           |          |
| 国債              |                            |                                     |           |           |          |
| USD             | 800,000                    | BAHRAIN 7.0000% 12/10/28 REGS       | 930,590   | 897,512   | 0.17     |
|                 |                            |                                     | 930,590   | 897,512   | 0.17     |
| 普通社債(固定金利債)     |                            |                                     |           |           |          |
| USD             | 300,000                    | BANK BAHRAIN&KUW 5.5000% 09/07/24   | 299,610   | 318,051   | 0.06     |
| USD             | 200,000                    | OIL & GAS HLD 8.3750% 07/11/28 REGS | 200,000   | 233,958   | 0.04     |
|                 |                            | 合計：バーレーン                            | 499,610   | 552,009   | 0.10     |
|                 |                            |                                     | 1,430,200 | 1,449,521 | 0.27     |
| <b>ベラルーシ</b>    |                            |                                     |           |           |          |
| 国債              |                            |                                     |           |           |          |
| USD             | 410,000                    | REP OF BELARU 6.2000% 28/02/30 REGS | 423,700   | 355,171   | 0.07     |
|                 |                            | 合計：ベラルーシ                            | 423,700   | 355,171   | 0.07     |
|                 |                            |                                     | 423,700   | 355,171   | 0.07     |
| <b>ベルギー</b>     |                            |                                     |           |           |          |
| 変動金利債           |                            |                                     |           |           |          |
| EUR             | 300,000                    | SOLVAY SA FRN 04/03/70              | 340,200   | 383,699   | 0.07     |
| EUR             | 200,000                    | KBC GROUP NV FRN 24/10/69           | 247,690   | 252,594   | 0.05     |
|                 |                            |                                     | 587,890   | 636,293   | 0.12     |
| 普通社債(固定金利債)     |                            |                                     |           |           |          |
| EUR             | 570,000                    | ONTEX GROUP 3.5000% 15/07/26        | 678,938   | 677,923   | 0.13     |
| EUR             | 400,000                    | HOUSE OF HR 7.5000% 15/01/27 REGS   | 492,433   | 506,745   | 0.10     |
| EUR             | 300,000                    | HOUSE OF FINA 4.3750% 15/07/26 REGS | 340,284   | 362,386   | 0.07     |
| EUR             | 100,000                    | SARENS FINANCE 5.7500% 21/02/27     | 62,637    | 118,471   | 0.02     |
|                 |                            | 合計：ベルギー                             | 1,574,292 | 1,665,525 | 0.32     |
|                 |                            |                                     | 2,162,182 | 2,301,818 | 0.44     |
| <b>バミューダ諸島</b>  |                            |                                     |           |           |          |
| その他債券           |                            |                                     |           |           |          |
| USD             | 200,000                    | TENGIZCHEVROIL 4% 15/08/26 REGS     | 217,250   | 217,072   | 0.04     |
| USD             | 212,733                    | DIGICEL 0.5 PIK 01/04/24            | 248,307   | 207,478   | 0.04     |
|                 |                            |                                     | 465,557   | 424,550   | 0.08     |
| 普通社債(固定金利債)     |                            |                                     |           |           |          |
| USD             | 450,000                    | INV ENER RES 6.2500% 26/04/29 REGS  | 463,559   | 486,562   | 0.09     |
| USD             | 410,000                    | NCL CORP 5.8750% 15/03/26 144A      | 411,188   | 429,475   | 0.08     |
| USD             | 400,000                    | FLY LEASING LTD 5.2500% 15/10/24    | 317,333   | 403,000   | 0.08     |
| USD             | 350,000                    | TENGIZCH FIN 2.6250% 15/08/25 REGS  | 347,942   | 359,034   | 0.07     |
| USD             | 300,000                    | CREDICORP LTD 2.7500% 17/06/25 REGS | 298,377   | 304,416   | 0.06     |
| USD             | 300,000                    | OUREDOR INTL 2.6250% 08/04/31 REGS  | 296,766   | 303,516   | 0.06     |
| USD             | 250,000                    | CBQ FINANCE L 2.0000% 12/05/26 EMTN | 249,363   | 248,750   | 0.05     |
| USD             | 250,000                    | VIKING CRUISES LTD 6.25% 15/5/25 14 | 250,375   | 247,500   | 0.05     |
| USD             | 250,000                    | NABORS INDS L 7.2500% 15/01/26 144A | 215,792   | 245,000   | 0.05     |
| USD             | 150,000                    | VIK CRUISES 13.0000% 15/05/25 144A  | 145,500   | 176,466   | 0.03     |
| USD             | 100,000                    | NCL CORP 10.2500% 01/02/26 144A     | 100,000   | 116,625   | 0.02     |
| USD             | 100,000                    | VIK CRUISES L 5.8750% 15/09/27 144A | 61,000    | 98,820    | 0.02     |
| USD             | 75,000                     | NCL FIN LTD 6.1250% 15/03/28 144A   | 75,000    | 78,938    | 0.01     |
| USD             | 75,000                     | VIK CRUISES L 7.0000% 15/02/29 144A | 75,000    | 78,032    | 0.01     |
| USD             | 50,000                     | NCL CORP 12.2500% 15/05/24 144A     | 49,500    | 60,313    | 0.01     |
| USD             | 50,000                     | VIKING OCEAN 5.6250% 15/02/29 144A  | 50,000    | 50,500    | 0.01     |
|                 |                            | 合計：バミューダ諸島                          | 3,406,695 | 3,686,947 | 0.70     |
|                 |                            |                                     | 3,872,252 | 4,111,497 | 0.78     |
| <b>ブラジル</b>     |                            |                                     |           |           |          |
| 国債              |                            |                                     |           |           |          |
| USD             | 2,550,000                  | BRAZIL REP OF 3.7500% 12/09/31      | 2,523,174 | 2,514,300 | 0.47     |
| USD             | 1,200,000                  | BRAZIL REP OF 3.8750% 12/06/30      | 1,187,015 | 1,215,025 | 0.23     |

| 通貨                      | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価      | 評価金額      | 純資産比率(%) |
|-------------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|----------|
| USD                     | 900,000                    | BRAZIL REP OF 4.7500% 14/01/50      | 889,321   | 871,380   | 0.17     |
| USD                     | 200,000                    | REP OF BRAZIL 5% 27/01/45           | 203,996   | 201,652   | 0.04     |
| USD                     | 77,000                     | FED REP OF BRAZIL 8.25% 20/01/34    | 97,885    | 106,838   | 0.02     |
| USD                     | 75,000                     | BRAZIL REP OF 7.1250% 20/01/37      | 80,958    | 95,250    | 0.02     |
|                         |                            |                                     | 4,982,349 | 5,004,445 | 0.95     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b>      |                            |                                     |           |           |          |
| USD                     | 500,000                    | VOTORANTIM CIMENTOS 7.25% 5/4/41 RE | 598,584   | 678,130   | 0.12     |
| USD                     | 300,000                    | CEMIG GER TAN 9.2500% 05/12/24 REGS | 296,229   | 345,753   | 0.07     |
| USD                     | 200,000                    | BRF SA 4.8750% 24/01/30 REGS        | 202,542   | 209,500   | 0.04     |
| USD                     | 200,000                    | CENTRAIS ELET 4.6250% 04/02/30 REGS | 200,000   | 206,002   | 0.04     |
| USD                     | 200,000                    | NATURA SA 4.1250% 03/05/28 REGS     | 204,100   | 205,000   | 0.04     |
|                         |                            |                                     | 1,501,455 | 1,644,385 | 0.31     |
|                         |                            | 合計：ブラジル                             | 6,483,804 | 6,648,830 | 1.26     |
| <b>英領ヴァージン諸島</b>        |                            |                                     |           |           |          |
| <b>普通社債(固定金利債)</b>      |                            |                                     |           |           |          |
| USD                     | 1,000,000                  | SINOPEC OVERS 3.5000% 03/05/26 REGS | 966,040   | 1,091,863 | 0.20     |
| USD                     | 500,000                    | GOLD FIELDS O 6.1250% 15/05/29 REGS | 527,675   | 591,900   | 0.11     |
| USD                     | 500,000                    | CHINA CINDA FIN 4.25% 23/04/25 REG  | 478,180   | 523,150   | 0.10     |
| USD                     | 500,000                    | SINOPEC GROUP 2.7000% 13/05/30 REGS | 501,090   | 516,032   | 0.10     |
| USD                     | 300,000                    | FORTUNE STAR BVI 5.25% 23/03/22     | 272,100   | 303,093   | 0.06     |
| USD                     | 270,000                    | SINO OCEAN LAND 6.0000% 30/07/24    | 276,480   | 295,719   | 0.06     |
| USD                     | 290,000                    | SCENERY JOURNEY 12.0000% 24/10/23   | 263,900   | 223,451   | 0.04     |
| USD                     | 200,000                    | STUDIO CITY F 5.0000% 15/01/29 144A | 200,000   | 201,804   | 0.04     |
|                         |                            |                                     | 3,485,465 | 3,747,012 | 0.71     |
|                         |                            | 合計：英領ヴァージン諸島                        | 3,485,465 | 3,747,012 | 0.71     |
| <b>カナダ</b>              |                            |                                     |           |           |          |
| <b>ペイ・イン・カインド(PIC)債</b> |                            |                                     |           |           |          |
| USD                     | 315,000                    | HUSKY III HLDING PIK 15/02/25 144A  | 318,100   | 340,200   | 0.06     |
| USD                     | 50,000                     | INTEL PKG HOLDCO PIK 15/01/26 144A  | 49,500    | 50,938    | 0.01     |
| USD                     | 439,762                    | ALBERTA /ALGOMA PIK 14% 13/02/20    | 365,544   | 0         | 0.00     |
|                         |                            |                                     | 733,144   | 391,138   | 0.07     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b>      |                            |                                     |           |           |          |
| USD                     | 500,000                    | FIRST QUANTUM 6.8750% 15/10/27 REGS | 499,999   | 543,749   | 0.09     |
| EUR                     | 300,000                    | PRIMO WATER H 3.8750% 31/10/28 REGS | 353,054   | 363,663   | 0.07     |
| USD                     | 290,000                    | CLARIOS GLOBA 8.5000% 15/05/27 144A | 294,763   | 316,099   | 0.06     |
| USD                     | 325,000                    | TELESAT CANAD 6.5000% 15/10/27 144A | 319,667   | 309,155   | 0.06     |
| USD                     | 275,000                    | COOKE/ALPHA 8.5000% 15/12/22 144A   | 266,910   | 281,874   | 0.05     |
| USD                     | 275,000                    | TEINE ENERGY 6.8750% 15/04/29 144A  | 277,625   | 281,874   | 0.05     |
| USD                     | 280,000                    | BAUSCH HEALTH 6.2500% 15/02/29 144A | 280,491   | 276,149   | 0.05     |
| USD                     | 275,000                    | BOMBARDIER INC 6% 15/10/22 144A     | 251,959   | 275,344   | 0.05     |
| USD                     | 265,000                    | TITAN ACQ/CO- 7.7500% 15/04/26 144A | 249,092   | 274,606   | 0.05     |
| USD                     | 265,000                    | BAUSCH HEALTH 7.2500% 30/05/29 144A | 257,051   | 270,853   | 0.05     |
| USD                     | 250,000                    | FIRST QUANTUM 6.8750% 01/03/26 REGS | 261,325   | 261,875   | 0.05     |
| USD                     | 250,000                    | BAUSCH HEALTH 5.0000% 30/01/28 144A | 243,125   | 237,148   | 0.04     |
| USD                     | 225,000                    | PARKLAND CORP 4.5000% 01/10/29 144A | 225,000   | 228,643   | 0.04     |
| USD                     | 225,000                    | NOVA CHEMICAL 4.2500% 15/05/29 144A | 225,656   | 227,250   | 0.04     |
| USD                     | 200,000                    | MEGLOBAL CANA 5.0000% 18/05/25 REGS | 200,000   | 224,220   | 0.04     |
| USD                     | 210,000                    | BOMBARDIER IN 7.5000% 01/12/24 144A | 215,400   | 219,188   | 0.04     |
| USD                     | 205,000                    | 1011778 BC UL 4.3750% 15/01/28 144A | 203,000   | 208,229   | 0.04     |
| USD                     | 200,000                    | FIRST QUANTUM MIN 7.25% 01/04/23 14 | 198,500   | 203,876   | 0.04     |
| USD                     | 150,000                    | ENCANA CORP 6.6250% 15/08/37        | 170,175   | 200,567   | 0.04     |
| USD                     | 200,000                    | GARDA SECURIT 6.0000% 01/06/29 144A | 200,000   | 198,500   | 0.04     |
| USD                     | 175,000                    | BAUSCH HLTH A 8.5000% 31/01/27 144A | 180,844   | 190,243   | 0.04     |
| USD                     | 175,000                    | MEG ENERGY CO 7.1250% 01/02/27 144A | 175,000   | 186,813   | 0.04     |
| USD                     | 175,000                    | BAFFINLAND IR 8.7500% 15/07/26 144A | 180,250   | 185,500   | 0.04     |
| EUR                     | 150,000                    | PANTHER BF AG 4.3750% 15/05/26 REGS | 189,100   | 184,652   | 0.04     |
| USD                     | 179,000                    | BAUSCH HEALTH 6.1250% 15/04/25 144A | 150,470   | 183,475   | 0.03     |
| USD                     | 175,000                    | FAIRSTONE FIN 7.8750% 15/07/24 144A | 174,097   | 182,438   | 0.03     |
| USD                     | 175,000                    | OPEN TEXT HLD 4.1250% 15/02/30 144A | 175,000   | 178,391   | 0.03     |
| USD                     | 175,000                    | MATTAMY GROUP 4.6250% 01/03/30 144A | 175,000   | 177,625   | 0.03     |
| USD                     | 150,000                    | VALEANT PHARM 9.0000% 15/12/25 144A | 153,238   | 160,688   | 0.03     |
| USD                     | 150,000                    | PARKLAND FUEL 5.8750% 15/07/27 144A | 150,000   | 160,500   | 0.03     |
| USD                     | 150,000                    | BOMBARDIER IN 7.8750% 15/04/27 144A | 148,869   | 155,625   | 0.03     |
| USD                     | 145,000                    | PRECISION DRI 6.8750% 15/01/29 144A | 144,067   | 149,350   | 0.03     |
| USD                     | 140,000                    | HUBBAY MINERA 4.5000% 01/04/26 144A | 141,000   | 140,613   | 0.03     |
| USD                     | 150,000                    | BAUSCH HEALTH 5.0000% 15/02/29 144A | 150,000   | 139,688   | 0.03     |
| USD                     | 150,000                    | BAUSCH HEALTH 5.2500% 30/01/30 144A | 143,250   | 139,500   | 0.03     |
| USD                     | 128,000                    | HUBBAY MINERA 6.1250% 01/04/29 144A | 129,950   | 136,068   | 0.03     |
| USD                     | 125,000                    | IAMGOLD CORP 5.7500% 15/10/28 144A  | 125,000   | 130,044   | 0.02     |
| USD                     | 100,000                    | EMPIRE COMMUN 7.0000% 15/12/25 144A | 101,313   | 105,000   | 0.02     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨          | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価       | 評価金額      | 純資産比率(%) |
|-------------|----------------------------|-------------------------------------|------------|-----------|----------|
| USD         | 100,000                    | BROOKFIELD RE 5.0000% 15/06/29 144A | 100,000    | 100,750   | 0.02     |
| USD         | 100,000                    | 1011778 BC UL 4.0000% 15/10/30 144A | 100,000    | 96,827    | 0.02     |
| USD         | 100,000                    | TELESAT CANAD 4.8750% 01/06/27 144A | 100,000    | 96,375    | 0.02     |
| USD         | 90,000                     | PANTHER BF AG 6.2500% 15/05/26 144A | 91,737     | 95,850    | 0.02     |
| USD         | 92,000                     | BAUSCH HEALTH 4.8750% 01/06/28 144A | 92,000     | 93,955    | 0.02     |
| USD         | 100,000                    | MOUNTAIN PROV 8.0000% 15/12/22 144A | 97,992     | 89,000    | 0.02     |
| USD         | 76,000                     | BOMBARDIER IN 7.1250% 15/06/26 144A | 76,000     | 79,230    | 0.02     |
| USD         | 50,000                     | MEG ENERGY CO 5.8750% 01/02/29 144A | 50,000     | 52,250    | 0.01     |
| USD         | 50,000                     | TELESAT CANAD 5.6250% 06/12/26 144A | 50,000     | 50,000    | 0.01     |
| USD         | 50,000                     | GFL ENVIRON 1 4.0000% 01/08/28 144A | 49,586     | 49,313    | 0.01     |
| USD         | 30,000                     | PRECISION DRI 7.1250% 15/01/26 144A | 29,550     | 30,900    | 0.01     |
| USD         | 125,000                    | NORTHWEST/DOM 7.1250% 01/11/22 144A | 123,704    | 13        | 0.00     |
| USD         | 18,750                     | SANJEL CORP 0% 29/12/69             | 0          | 0         | 0.00     |
| USD         | 18,750                     | SANJEL CORP 0.0000% 29/12/69 INTR   | 0          | 0         | 0.00     |
| USD         | 18,750                     | SANJEL CORP 0.0000% 29/12/69 INTR   | 0          | 0         | 0.00     |
| USD         | 1,150,000                  | LIGHTSTREAM 8.6250% 01/02/20 144A   | 1,144,250  | 0         | 0.00     |
| USD         | 18,750                     | SANJEL CORP 0.0000% 29/12/69 INTR   | 0          | 0         | 0.00     |
| USD         | 500,000                    | SANJEL CORP 0% 31/12/49             | 453,500    | 0         | 0.00     |
| USD         | 18,750                     | SANJEL CORP 0% 29/12/69 INTR        | 0          | 0         | 0.00     |
| USD         | 18,750                     | SANJEL CORP 0.0000% 29/12/69 INTR   | 0          | 0         | 0.00     |
| USD         | 18,750                     | SANJEL CORP 0% 31/12/49             | 0          | 0         | 0.00     |
| USD         | 18,750                     | SANJEL CORP 0.0000% 29/12/69 INTR   | 0          | 0         | 0.00     |
|             |                            |                                     | 10,537,559 | 9,123,538 | 1.73     |
|             |                            |                                     | 11,270,703 | 9,514,676 | 1.80     |
|             |                            | 合計：カナダ                              |            |           |          |
| ケイマン諸島      |                            |                                     |            |           |          |
| 変動金利債       |                            |                                     |            |           |          |
| USD         | 650,000                    | BANCO BRADESCO 9.25% 29/10/49 REGS  | 685,635    | 711,750   | 0.13     |
| USD         | 400,000                    | DP WORLD SALAA FRN 01/01/70         | 433,600    | 439,456   | 0.08     |
| USD         | 200,000                    | CK HUTCHISON CAP FRN 12/11/69 REGS  | 204,900    | 203,000   | 0.04     |
| USD         | 200,000                    | QIB SUKUK LTD FRN 07/02/25 EMTN     | 201,360    | 201,751   | 0.04     |
|             |                            |                                     | 1,525,495  | 1,555,957 | 0.29     |
| その他債券       |                            |                                     |            |           |          |
| USD         | 710,830                    | GLB AIR LEASE CO PIK 15/09/24 144A  | 669,936    | 714,349   | 0.14     |
| USD         | 175,000                    | TRANSOCEAN 5.8750% 15/01/24 144A    | 130,046    | 123,386   | 0.02     |
| USD         | 100,000                    | TRANSOCEAN PO 6.8750% 01/02/27 144A | 100,143    | 100,000   | 0.02     |
| USD         | 75,000                     | TRANSOCEAN SE 5.3750% 15/05/23 144A | 68,635     | 67,372    | 0.01     |
|             |                            |                                     | 968,760    | 1,005,107 | 0.19     |
| 普通社債(固定金利債) |                            |                                     |            |           |          |
| USD         | 900,000                    | CSN ISLANDS X 6.7500% 28/01/28 REGS | 958,211    | 990,449   | 0.18     |
| USD         | 700,000                    | COUNTRY GARDEN 8.0000% 27/01/24     | 729,353    | 735,868   | 0.13     |
| USD         | 550,000                    | SA GLOBAL SUK 2.6940% 17/06/31 REGS | 550,000    | 556,820   | 0.10     |
| USD         | 500,000                    | TENCENT HOLDI 3.5950% 19/01/28 REGS | 510,371    | 547,654   | 0.09     |
| USD         | 370,000                    | VALE OVERSEAS 6.875% 10/11/39       | 432,664    | 515,225   | 0.10     |
| USD         | 365,000                    | VALE OVERSEAS 6.875% 21/11/36       | 403,474    | 500,309   | 0.09     |
| USD         | 450,000                    | SUNAC CHINA HLDG 7.5000% 01/02/24   | 440,235    | 459,234   | 0.09     |
| USD         | 400,000                    | ALIBABA GROUP 4.0000% 06/12/37      | 447,834    | 450,607   | 0.09     |
| USD         | 400,000                    | LONGFOR HOLDINGS 4.5000% 16/01/28   | 361,920    | 443,724   | 0.08     |
| USD         | 400,000                    | HUTCH WHAMPOA 3.625% 31/10/24 REGS  | 407,688    | 435,656   | 0.08     |
| USD         | 400,000                    | DP WORLD CRES 3.8750% 18/07/29 EMTN | 396,204    | 434,000   | 0.08     |
| USD         | 400,000                    | SA GLOBAL SUK 0.9460% 17/06/24 REGS | 400,000    | 399,488   | 0.08     |
| USD         | 400,000                    | CIFI HOLDINGS 4.4500% 17/08/26      | 399,928    | 398,149   | 0.08     |
| USD         | 400,000                    | YUZHOU GROUP 8.5000% 26/02/24       | 409,800    | 364,206   | 0.07     |
| USD         | 335,000                    | SANDS CHINA LTD 4.3750% 18/06/30    | 333,593    | 362,192   | 0.07     |
| USD         | 300,000                    | COUNTRY GARDEN 6.1500% 17/09/25     | 319,500    | 328,876   | 0.06     |
| USD         | 300,000                    | GRUPOSURA FINANCE 5.5% 29/04/26 REG | 312,450    | 324,378   | 0.06     |
| USD         | 300,000                    | ARABIAN CENTR 5.3750% 26/11/24 REGS | 300,000    | 313,800   | 0.06     |
| USD         | 300,000                    | SUNAC CHINA HLDG 8.3500% 19/04/23   | 284,850    | 310,658   | 0.06     |
| USD         | 300,000                    | GEMS MENASA K 7.1250% 31/07/26 REGS | 300,000    | 310,500   | 0.06     |
| USD         | 300,000                    | KAISA GROUP 11.9500% 22/10/22 REGS  | 302,370    | 307,650   | 0.06     |
| USD         | 400,000                    | CHINA EVERGRANDE 7.5000% 28/06/23   | 398,600    | 284,209   | 0.05     |
| USD         | 250,000                    | AHB SUKUK CO 4.3750% 19/09/23       | 249,025    | 268,750   | 0.05     |
| USD         | 260,000                    | GRUPO AVAL LT 4.3750% 04/02/30 REGS | 258,523    | 256,360   | 0.05     |
| USD         | 260,000                    | ALIBABA GROUP 2.1250% 09/02/31      | 259,581    | 256,114   | 0.05     |
| USD         | 200,000                    | SAUDI ELEC GL 5.5000% 08/04/44 REGS | 257,000    | 253,500   | 0.05     |
| USD         | 250,000                    | SA GLOBAL SUK 1.6020% 17/06/26 REGS | 250,000    | 249,825   | 0.05     |
| USD         | 250,000                    | XP INC 3.2500% 01/07/26 REGS        | 247,155    | 247,305   | 0.05     |
| USD         | 200,000                    | MAF SUKUK LTD 4.6380% 14/05/29      | 200,000    | 225,176   | 0.04     |
| USD         | 200,000                    | COUNTRY GARDEN 7.2500% 08/04/26     | 226,900    | 222,325   | 0.04     |
| USD         | 200,000                    | SAUDI ELEC 4.2220% 27/01/24         | 200,000    | 216,500   | 0.04     |
| USD         | 200,000                    | SWIRE PACIFIC 4.5% 09/10/23 EMTN    | 220,398    | 215,988   | 0.04     |
| USD         | 200,000                    | TENCENT HOLD 3.6800% 22/04/41 REGS  | 199,944    | 212,405   | 0.04     |
| USD         | 200,000                    | SHIMAO GRP HLDGS 5.6000% 15/07/26   | 221,000    | 210,035   | 0.04     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨                 | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価       | 評価金額       | 純資産比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------|------------|----------|
| USD                | 200,000                    | ABQ FINANCE 3.1250% 24/09/24 EMTN   | 208,600    | 209,500    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | DIB SUKUK LTD 2.9500% 16/01/26 EMTN | 205,250    | 208,774    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | DAR AL-ARKAN SUK 6.7500% 15/02/25   | 197,682    | 205,876    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | CN HONGQIAO LTD 6.2500% 08/06/24    | 203,200    | 203,416    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | DOHA FINANCE 2.3750% 31/03/26 EMTN  | 201,550    | 201,406    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | KAISA GROUP 10.8750% 23/07/23       | 208,680    | 199,771    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | QNB FINANCE L 1.3750% 26/01/26 EMTN | 199,002    | 198,464    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | SUNAC CHINA HLDG 6.5000% 10/01/25   | 200,000    | 196,255    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | CENTRAL CHINA 7.6500% 27/08/23      | 199,086    | 189,106    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | KAISA GROUP 11.7000% 11/11/25       | 203,400    | 188,539    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | YUZHOU GROUP 7.8500% 12/08/26       | 173,880    | 156,119    | 0.03     |
| USD                | 135,000                    | SPIRIT LOYALT 8.0000% 20/09/25 144A | 137,689    | 153,225    | 0.03     |
| USD                | 200,000                    | CHINA EVERGRANDE 9.5000% 29/03/24   | 179,839    | 140,102    | 0.03     |
| USD                | 175,000                    | SHELF DRL HOL 8.2500% 15/02/25 144A | 174,024    | 139,948    | 0.03     |
| USD                | 200,000                    | CHINA EVERGRANDE 8.7500% 28/06/25   | 180,400    | 133,375    | 0.03     |
| USD                | 75,000                     | VALE OVERSEAS 8.2500% 17/01/34      | 109,512    | 109,500    | 0.02     |
| USD                | 100,000                    | TRANSOCEAN IN 8.0000% 01/02/27 144A | 84,250     | 84,000     | 0.02     |
| USD                | 75,000                     | SHELF DRL HOL 8.8750% 15/11/24 144A | 73,562     | 77,438     | 0.01     |
| USD                | 56,000                     | TRANSOCEAN I 11.5000% 30/01/27 144A | 118,398    | 59,651     | 0.01     |
|                    |                            |                                     | 15,446,400 | 15,662,400 | 2.97     |
|                    |                            | 合計：ケイマン諸島                           | 17,940,830 | 18,223,464 | 3.45     |
| <b>チリ</b>          |                            |                                     |            |            |          |
| <b>変動金利債</b>       |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 200,000                    | AES GENER SA FRN 26/03/79 REGS      | 207,900    | 214,000    | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 207,900    | 214,000    | 0.04     |
| <b>その他債券</b>       |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 800,000                    | EMPRESA NACIO 5.2500% 06/11/29 REGS | 827,799    | 893,091    | 0.17     |
| USD                | 200,000                    | GNL QUINTERO 4.6340% 31/07/29 REGS  | 215,400    | 218,000    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | INVERSIONES P 5.1250% 15/06/33 REGS | 199,994    | 198,000    | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 1,243,193  | 1,309,091  | 0.25     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 370,000                    | COLBUN SA 3.9500% 11/10/27 REGS     | 368,971    | 403,766    | 0.09     |
| USD                | 300,000                    | CODELCO INC 4.25% 17/07/42 REGS     | 351,390    | 338,702    | 0.06     |
| USD                | 200,000                    | CODELCO INC 5.625% 18/10/43 REGS    | 275,940    | 266,948    | 0.05     |
| USD                | 200,000                    | CODELCO INC 4.3750% 05/02/49 REGS   | 217,440    | 234,363    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | EMPRESA METRO 3.6500% 07/05/30 REGS | 199,518    | 215,870    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | EMPRESA ELECTRICA 4.56% 30/4/25 REG | 187,100    | 145,359    | 0.03     |
| USD                | 60,000                     | ENEL CHILE SA 4.8750% 12/06/28      | 69,241     | 69,198     | 0.01     |
|                    |                            |                                     | 1,669,600  | 1,674,206  | 0.32     |
|                    |                            | 合計：チリ                               | 3,120,693  | 3,197,297  | 0.61     |
| <b>中国</b>          |                            |                                     |            |            |          |
| <b>変動金利債</b>       |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 200,000                    | CHINA CONST BANK FRN 24/06/30       | 202,074    | 204,244    | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 202,074    | 204,244    | 0.04     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 800,000                    | BANK OF CHINA 5% 13/11/24 REGS      | 843,816    | 892,626    | 0.17     |
| USD                | 500,000                    | EXPORT IMPORT BK 3.625% 31/07/24 R  | 539,425    | 543,047    | 0.10     |
|                    |                            |                                     | 1,383,241  | 1,435,673  | 0.27     |
|                    |                            | 合計：中国                               | 1,585,315  | 1,639,917  | 0.31     |
| <b>コロンビア</b>       |                            |                                     |            |            |          |
| <b>変動金利債</b>       |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 350,000                    | BANCO DAVIVIENDA FRN 22/10/69 REGS  | 350,000    | 366,888    | 0.07     |
| USD                | 300,000                    | BANCOLOMBIA FRN 18/10/27            | 300,000    | 304,503    | 0.06     |
| USD                | 200,000                    | BANCOLOMBIA FRN 18/12/29            | 210,500    | 202,700    | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 860,500    | 874,091    | 0.17     |
| <b>国債</b>          |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 600,000                    | COLOMBIA REP OF 3.2500% 22/04/32    | 594,192    | 587,611    | 0.10     |
| USD                | 400,000                    | COLOMBIA REP OF 4.1250% 22/02/42    | 393,968    | 388,347    | 0.07     |
| USD                | 200,000                    | REP OF COLOMBIA 5% 15/06/45         | 208,878    | 213,031    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | REP OF COLOMBIA 3.875% 25/04/27     | 204,480    | 212,704    | 0.04     |
| USD                | 100,000                    | REP OF COLOMBIA 6.125% 18/01/41     | 111,282    | 118,258    | 0.02     |
| USD                | 70,000                     | COLOMBIA REP OF 8.1250% 21/05/24    | 84,490     | 82,784     | 0.02     |
|                    |                            |                                     | 1,597,290  | 1,602,735  | 0.29     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 513,000                    | ECOPETROL SA 6.8750% 29/04/30       | 545,240    | 619,678    | 0.12     |
| USD                | 600,000                    | OLEODUCTO CEN 4.0000% 14/07/27 REGS | 599,948    | 619,500    | 0.12     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨                 | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                  | 取得時価      | 評価金額      | 純資産比率(%) |
|--------------------|----------------------------|--------------------------------------|-----------|-----------|----------|
| USD                | 50,000                     | ECOPETROL SA 5.875% 28/05/45         | 50,334    | 53,625    | 0.01     |
|                    |                            |                                      | 1,195,522 | 1,292,803 | 0.25     |
|                    |                            | 合計：コロンビア                             | 3,653,312 | 3,769,629 | 0.71     |
| <b>コスタリカ</b>       |                            |                                      |           |           |          |
| 国債                 |                            |                                      |           |           |          |
| USD                | 200,000                    | REP OF COSTA RICA 7% 4/04/44 REGS    | 198,600   | 207,250   | 0.04     |
|                    |                            |                                      | 198,600   | 207,250   | 0.04     |
|                    |                            | 合計：コスタリカ                             | 198,600   | 207,250   | 0.04     |
| <b>キプロス</b>        |                            |                                      |           |           |          |
| 転換社債               |                            |                                      |           |           |          |
| USD                | 200,000                    | OZON HOLDING PL CV 1.8750% 24/02/26  | 200,000   | 200,804   | 0.04     |
|                    |                            |                                      | 200,000   | 200,804   | 0.04     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                      |           |           |          |
| USD                | 250,000                    | INTERPIPE HLD 8.3750% 13/05/26 REGS  | 250,000   | 249,395   | 0.05     |
|                    |                            |                                      | 250,000   | 249,395   | 0.05     |
|                    |                            | 合計：キプロス                              | 450,000   | 450,199   | 0.09     |
| <b>チェコ共和国</b>      |                            |                                      |           |           |          |
| 普通社債(固定金利債)        |                            |                                      |           |           |          |
| EUR                | 500,000                    | SAZKA GROUP A 4.1250% 20/11/24 REGS  | 551,625   | 607,561   | 0.11     |
| EUR                | 350,000                    | SAZKA GROUP A 3.8750% 15/02/27 REGS  | 382,491   | 419,643   | 0.08     |
| EUR                | 300,000                    | ENERGO PRO AS 4.0000% 07/12/22       | 356,769   | 353,721   | 0.07     |
| EUR                | 100,000                    | ENERGO PRO AS 4.5000% 04/05/24       | 118,686   | 116,968   | 0.02     |
|                    |                            |                                      | 1,409,571 | 1,497,893 | 0.28     |
|                    |                            | 合計：チェコ共和国                            | 1,409,571 | 1,497,893 | 0.28     |
| <b>デンマーク</b>       |                            |                                      |           |           |          |
| 普通社債(固定金利債)        |                            |                                      |           |           |          |
| EUR                | 800,000                    | DKT FINANCE 7.0000% 17/06/23 REGS    | 985,266   | 968,456   | 0.18     |
| EUR                | 250,000                    | NORICAN A/S 4.5000% 15/05/23         | 242,649   | 293,046   | 0.06     |
| USD                | 200,000                    | DKT FINANCE 9.3750% 17/06/23 144A    | 214,500   | 204,000   | 0.04     |
|                    |                            |                                      | 1,442,415 | 1,465,502 | 0.28     |
|                    |                            | 合計：デンマーク                             | 1,442,415 | 1,465,502 | 0.28     |
| <b>ドミニカ共和国</b>     |                            |                                      |           |           |          |
| 国債                 |                            |                                      |           |           |          |
| USD                | 375,000                    | DOMINICAN REP 7.45% 30/04/44 REGS    | 399,621   | 453,863   | 0.09     |
| USD                | 350,000                    | DOMINICAN REP 5.8750% 30/01/60 REGS  | 350,683   | 350,000   | 0.07     |
| USD                | 200,000                    | DOMINICAN REP 6.0000% 19/07/28 REGS  | 214,610   | 227,250   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | DOMINICAN REP 4.5000% 30/01/30 REGS  | 209,442   | 203,750   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | DOMINICAN REP 5.3000% 21/01/41 REGS  | 207,980   | 200,250   | 0.04     |
| USD                | 100,000                    | DOMINICAN REP 6.8750% 29/01/26 REGS  | 113,250   | 116,125   | 0.02     |
| USD                | 100,000                    | DOMINICAN REP 6.85% 27/01/45 REGS    | 114,556   | 113,250   | 0.02     |
|                    |                            |                                      | 1,610,142 | 1,664,488 | 0.32     |
|                    |                            | 合計：ドミニカ共和国                           | 1,610,142 | 1,664,488 | 0.32     |
| <b>エクアドル</b>       |                            |                                      |           |           |          |
| 国債                 |                            |                                      |           |           |          |
| USD                | 1,582,298                  | REPUBLIC OF E 1.0000% 31/07/35 REGS  | 1,241,758 | 1,077,941 | 0.20     |
| USD                | 903,568                    | REPUBLIC OF E 5.0000% 31/07/30 REGS  | 788,790   | 772,551   | 0.15     |
| USD                | 450,928                    | REPUBLIC OF E 0.5000% 31/07/40 REGS  | 403,402   | 278,123   | 0.05     |
|                    |                            |                                      | 2,433,950 | 2,128,615 | 0.40     |
|                    |                            | 合計：エクアドル                             | 2,433,950 | 2,128,615 | 0.40     |
| <b>エジプト</b>        |                            |                                      |           |           |          |
| 国債                 |                            |                                      |           |           |          |
| USD                | 400,000                    | ARAB REP EGYPT 8.8750% 29/05/50 REGS | 400,000   | 430,020   | 0.08     |
| USD                | 200,000                    | ARAB REP EGYPT 7.6250% 29/05/32 REGS | 217,340   | 212,196   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | ARAB REP EGYPT 8.7002% 01/03/49 REGS | 210,980   | 210,750   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | ARAB REPUBLIC EGYPT 8.5% 31/1/47 RE  | 200,000   | 208,004   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | ARAB REP EGYPT 7.9030% 21/02/48 REGS | 200,000   | 197,496   | 0.04     |
|                    |                            |                                      | 1,228,320 | 1,258,466 | 0.24     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                      |           |           |          |
| USD                | 400,000                    | AFREXIMBANK 2.6340% 17/05/26 REGS    | 400,680   | 404,883   | 0.08     |
| USD                | 400,000                    | ARAB REP EGYPT 5.8750% 16/02/31 REGS | 400,000   | 388,000   | 0.07     |
|                    |                            |                                      | 800,680   | 792,883   | 0.15     |
|                    |                            | 合計：エジプト                              | 2,029,000 | 2,051,349 | 0.39     |

| 通貨                  | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価      | 評価金額      | 純資産比率(%) |
|---------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|----------|
| <b>国債</b>           |                            |                                     |           |           |          |
| <b>エルサルバドル</b>      |                            |                                     |           |           |          |
| USD                 | 500,000                    | REP EL SALVADOR 7.65% 15/6/35 REGS  | 515,440   | 461,875   | 0.09     |
| USD                 | 315,000                    | REP EL SALVADOR 8.625% 28/2/29 REG  | 351,211   | 309,481   | 0.06     |
| USD                 | 150,000                    | EL SALVADOR R 7.1246% 20/01/50 REGS | 143,250   | 129,000   | 0.02     |
| USD                 | 39,000                     | EL SALVADOR R 8.2500% 10/04/32 REGS | 42,051    | 37,050    | 0.01     |
|                     |                            |                                     | 1,051,952 | 937,406   | 0.18     |
|                     |                            | 合計：エルサルバドル                          | 1,051,952 | 937,406   | 0.18     |
| <b>フィンランド</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| <b>普通社債(固定金利債)</b>  |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                 | 628,000                    | TEOLLISUUDEN 1.3750% 23/06/28 EMTN  | 759,166   | 744,393   | 0.15     |
| EUR                 | 514,000                    | TEOLLISUUDEN 1.1250% 09/03/26 EMTN  | 567,983   | 615,439   | 0.12     |
| EUR                 | 230,000                    | PHM GROUP 4.7500% 18/06/26          | 280,359   | 275,092   | 0.05     |
| USD                 | 225,000                    | SPA HOLDINGS 4.8750% 04/02/28 144A  | 225,000   | 226,688   | 0.04     |
| EUR                 | 120,000                    | NOKIA OYJ 3.1250% 15/05/28 EMTN     | 129,784   | 158,730   | 0.03     |
| EUR                 | 101,000                    | NOKIA OYJ 2.3750% 15/05/25 EMTN     | 109,082   | 127,713   | 0.02     |
| EUR                 | 100,000                    | SPA HOLDINGS 3.6250% 04/02/28 REGS  | 119,655   | 119,903   | 0.02     |
|                     |                            |                                     | 2,191,029 | 2,267,958 | 0.43     |
|                     |                            | 合計：フィンランド                           | 2,191,029 | 2,267,958 | 0.43     |
| <b>フランス</b>         |                            |                                     |           |           |          |
| <b>変動金利債</b>        |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                 | 1,200,000                  | ELEC DE FRANCE FRN 15/09/69         | 1,465,342 | 1,490,602 | 0.27     |
| EUR                 | 600,000                    | ELEC DE FRANCE FRN 01/06/70         | 734,474   | 717,631   | 0.14     |
| EUR                 | 350,000                    | BURGER KING FR S FRN 01/05/23 REGS  | 390,404   | 416,634   | 0.08     |
| USD                 | 300,000                    | SOCIETE GENERALE FRN 04/04/70 REGS  | 323,595   | 327,750   | 0.06     |
| EUR                 | 200,000                    | VEOLIA ENVRNMT FRN 20/04/70         | 234,950   | 239,210   | 0.05     |
| GBP                 | 100,000                    | ELEC DE FRANCE FRN 22/07/69 EMTN    | 149,803   | 156,910   | 0.03     |
| EUR                 | 100,000                    | EDF FRN 22/01/49 EMTN               | 125,091   | 133,607   | 0.03     |
| EUR                 | 100,000                    | MUTUELLE ASSUR FRN 21/12/69         | 120,980   | 119,746   | 0.02     |
|                     |                            |                                     | 3,544,639 | 3,602,090 | 0.68     |
| <b>普通株式</b>         |                            |                                     |           |           |          |
| —                   | 152,700                    | NOVASEP HOLDING                     | 9,073     | 8,905     | 0.00     |
|                     |                            |                                     | 9,073     | 8,905     | 0.00     |
| <b>ステップアップ/ダウン債</b> |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                 | 200,000                    | CASINO GUICHARD 3.248% 7/3/24 EMTN  | 199,282   | 241,888   | 0.05     |
|                     |                            |                                     | 199,282   | 241,888   | 0.05     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b>  |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                 | 1,062,000                  | FAURECIA 3.7500% 15/06/28           | 1,286,573 | 1,330,297 | 0.26     |
| EUR                 | 1,000,000                  | ALTICE FRANCE 8.0000% 15/05/27 144A | 1,143,478 | 1,283,881 | 0.25     |
| EUR                 | 800,000                    | ORANO SA 3.3750% 23/04/26 EMTN      | 904,679   | 1,031,103 | 0.21     |
| EUR                 | 800,000                    | ALTICE FRANCE 5.8750% 01/02/27 REGS | 950,114   | 1,009,007 | 0.19     |
| EUR                 | 656,000                    | GETLINK SE 3.5000% 30/10/25         | 782,008   | 809,983   | 0.15     |
| EUR                 | 590,000                    | PARTS EUROPE 6.5000% 16/07/25 REGS  | 688,457   | 735,652   | 0.14     |
| EUR                 | 600,000                    | IGERA GROUP 4.2500% 30/09/24 REGS   | 723,345   | 714,717   | 0.14     |
| EUR                 | 500,000                    | CMA CGM SA 7.5000% 15/01/26 REGS    | 621,567   | 661,648   | 0.13     |
| EUR                 | 500,000                    | PAPREC HOLDIN 4.0000% 31/03/25 REGS | 619,075   | 603,976   | 0.11     |
| EUR                 | 500,000                    | LA FINAC ATALIAN 4% 15/05/24 REGS   | 519,964   | 590,878   | 0.11     |
| EUR                 | 400,000                    | ALTICE FRANCE 8.0000% 15/05/27 REGS | 449,572   | 513,552   | 0.10     |
| EUR                 | 422,000                    | CAB 3.3750% 01/02/28 REGS           | 511,431   | 499,711   | 0.09     |
| EUR                 | 400,000                    | ORANO SA 2.7500% 08/03/28 EMTN      | 471,155   | 497,024   | 0.09     |
| EUR                 | 410,000                    | LOXAM SAS 6% 15/04/25 REGS          | 443,435   | 495,870   | 0.09     |
| EUR                 | 400,000                    | AIR FRANCE-KLM 3.8750% 01/07/26     | 475,596   | 468,671   | 0.09     |
| USD                 | 450,000                    | ALTICE FRANCE 5.1250% 15/07/29 144A | 450,000   | 452,498   | 0.09     |
| EUR                 | 310,000                    | RUBIS TERMINA 5.6250% 15/05/25 REGS | 349,192   | 388,341   | 0.07     |
| EUR                 | 300,000                    | TEREOS FIN GR 7.5000% 30/10/25 REGS | 380,842   | 381,526   | 0.07     |
| EUR                 | 300,000                    | LOXAM SAS 5.7500% 15/07/27          | 350,893   | 371,311   | 0.07     |
| EUR                 | 300,000                    | CMA CGM SA 5.2500% 15/01/25 REGS    | 273,849   | 364,981   | 0.07     |
| EUR                 | 290,000                    | CONSTELLIUM S 3.1250% 15/07/29 REGS | 351,756   | 342,541   | 0.06     |
| EUR                 | 278,000                    | PAPREC HOLDIN 3.5000% 01/07/28 REGS | 331,766   | 330,001   | 0.06     |
| EUR                 | 260,000                    | AFFLELOU SAS 4.2500% 19/05/26 REGS  | 315,705   | 315,584   | 0.06     |
| EUR                 | 250,000                    | BURGER KING FRANCE 6% 01/05/24 REGS | 300,830   | 302,430   | 0.06     |
| EUR                 | 230,000                    | MOBILUX FINAN 4.2500% 15/07/28 REGS | 273,918   | 273,745   | 0.05     |
| EUR                 | 210,000                    | QUATRIM 5.8750% 15/01/24 REGS       | 232,250   | 259,636   | 0.05     |
| EUR                 | 210,000                    | CONSTANTIN IN 5.3750% 15/04/25 REGS | 236,139   | 247,897   | 0.05     |
| USD                 | 250,000                    | CONSTELLIUM S 3.7500% 15/04/29 144A | 250,000   | 247,500   | 0.05     |
| EUR                 | 200,000                    | BANJAY ENTER 3.5000% 01/03/25 REGS  | 210,027   | 240,400   | 0.05     |
| EUR                 | 190,000                    | CASINO GUICHARD 5.2500% 15/04/27    | 223,497   | 231,207   | 0.04     |
| USD                 | 200,000                    | ALTICE FRANCE 8.1250% 01/02/27 144A | 189,998   | 217,900   | 0.04     |
| USD                 | 200,000                    | BANJAY ENTER 5.3750% 01/03/25 144A  | 186,000   | 206,288   | 0.04     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨                      | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価       | 評価金額       | 純資産比率(%) |
|-------------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------|------------|----------|
| EUR                     | 150,000                    | GOLDSTORY SAS 5.3750% 01/03/26 REGS | 181,387    | 182,542    | 0.03     |
| EUR                     | 131,000                    | CHROME BIDCO 3.5000% 31/05/28 REGS  | 158,779    | 158,047    | 0.03     |
| EUR                     | 126,000                    | CGG SA 7.7500% 01/04/27 REGS        | 150,759    | 155,336    | 0.03     |
| EUR                     | 120,000                    | ALTICE FRANCE 4.0000% 15/07/29 REGS | 142,704    | 141,842    | 0.03     |
| EUR                     | 110,000                    | BANIJAY GROUP 6.5000% 01/03/26 REGS | 121,666    | 135,135    | 0.03     |
| EUR                     | 108,000                    | FAURECIA 2.3750% 15/06/29           | 128,542    | 130,873    | 0.02     |
| EUR                     | 100,000                    | IQERA GROUP 6.5000% 30/09/24 REGS   | 116,565    | 123,045    | 0.02     |
| EUR                     | 100,000                    | REXEL SA 2.1250% 15/06/28           | 120,735    | 121,522    | 0.02     |
| EUR                     | 100,000                    | LABORATOIRE 5.0000% 01/02/29 REGS   | 120,925    | 121,150    | 0.02     |
| EUR                     | 100,000                    | TEREOS FIN GP 4.125% 16/06/23       | 112,327    | 120,134    | 0.02     |
|                         |                            |                                     | 16,851,500 | 17,809,382 | 3.38     |
|                         |                            | 合計：フランス                             | 20,604,494 | 21,662,265 | 4.11     |
| <b>ガボン</b>              |                            |                                     |            |            |          |
| 国債                      |                            |                                     |            |            |          |
| USD                     | 400,000                    | REPUBLIC OF G 6.6250% 06/02/31 REGS | 400,400    | 402,790    | 0.08     |
|                         |                            |                                     | 400,400    | 402,790    | 0.08     |
|                         |                            | 合計：ガボン                              | 400,400    | 402,790    | 0.08     |
| <b>ジョージア</b>            |                            |                                     |            |            |          |
| 国債                      |                            |                                     |            |            |          |
| USD                     | 200,000                    | GEORGIA REP O 2.7500% 22/04/26 REGS | 198,844    | 203,001    | 0.04     |
|                         |                            |                                     | 198,844    | 203,001    | 0.04     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b>      |                            |                                     |            |            |          |
| USD                     | 200,000                    | TBC BANK JSC 5.7500% 19/06/24 REGS  | 201,200    | 214,000    | 0.04     |
| USD                     | 200,000                    | GEORGIAN RAIL 4.0000% 17/06/28 REGS | 200,000    | 201,500    | 0.04     |
|                         |                            |                                     | 401,200    | 415,500    | 0.08     |
|                         |                            | 合計：ジョージア                            | 600,044    | 618,501    | 0.12     |
| <b>ドイツ</b>              |                            |                                     |            |            |          |
| 転換社債                    |                            |                                     |            |            |          |
| EUR                     | 200,000                    | TUI AG CV 5.0000% 16/04/28          | 238,090    | 248,724    | 0.05     |
|                         |                            |                                     | 238,090    | 248,724    | 0.05     |
| <b>変動金利債</b>            |                            |                                     |            |            |          |
| EUR                     | 800,000                    | COMMERZBANK AG FRN 09/04/70         | 904,854    | 1,049,570  | 0.21     |
| EUR                     | 600,000                    | NOVEM GROUP FRN 15/05/24 REGS       | 668,970    | 715,683    | 0.14     |
| EUR                     | 400,000                    | AAREAL BK AG FRN 29/11/49           | 434,486    | 490,274    | 0.09     |
| EUR                     | 280,000                    | TK ELEVATOR MID FRN 15/07/27 REGS   | 313,272    | 336,984    | 0.06     |
| GBP                     | 200,000                    | DEUTSCHE BANK AG FRN 22/12/28 EMTN  | 276,441    | 276,016    | 0.05     |
| EUR                     | 200,000                    | DEUTSCHE BANK AG FRN 30/04/70       | 240,467    | 247,370    | 0.05     |
| USD                     | 200,000                    | COMMERZBANK AG FRN 09/04/70         | 200,000    | 217,250    | 0.04     |
| EUR                     | 100,000                    | COMMERZBANK AG FRN 05/12/30 EMTN    | 109,559    | 131,819    | 0.02     |
| EUR                     | 100,000                    | BAYER AG FRN 12/11/79               | 124,725    | 123,770    | 0.02     |
|                         |                            |                                     | 3,272,774  | 3,588,736  | 0.68     |
| <b>ペイ・イン・カインド(PIK)債</b> |                            |                                     |            |            |          |
| EUR                     | 500,000                    | IHO VERWALTUNGS PIK 15/05/25 REGS   | 589,857    | 604,334    | 0.11     |
|                         |                            |                                     | 589,857    | 604,334    | 0.11     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b>      |                            |                                     |            |            |          |
| EUR                     | 800,000                    | VERTICAL HOLD 6.6250% 15/07/28 REGS | 978,332    | 1,014,014  | 0.19     |
| EUR                     | 900,000                    | KME SE 6.7500% 01/02/23 REGS        | 1,063,001  | 990,760    | 0.18     |
| EUR                     | 700,000                    | TELE COLUMBUS 3.8750% 02/05/25 REGS | 831,595    | 842,801    | 0.16     |
| EUR                     | 720,000                    | STANDARD PROF 6.2500% 30/04/26 REGS | 868,612    | 826,454    | 0.16     |
| EUR                     | 664,000                    | NIDDA HEALTHC 3.5000% 30/09/24 REGS | 755,198    | 787,872    | 0.15     |
| EUR                     | 600,000                    | CTC BONDCO GM 5.2500% 15/12/25 REGS | 700,422    | 723,143    | 0.14     |
| EUR                     | 600,000                    | RAFFINERIE HE 6.3750% 01/12/22 REGS | 703,660    | 678,230    | 0.13     |
| EUR                     | 500,000                    | HP PELZER HLDG 4.125% 01/04/24 REGS | 530,330    | 579,426    | 0.11     |
| EUR                     | 470,000                    | PEACH PROPERT 3.5000% 15/02/23 REGS | 515,416    | 573,891    | 0.11     |
| EUR                     | 400,000                    | HT TROPLAST A 9.2500% 15/07/25 REGS | 463,214    | 526,805    | 0.10     |
| EUR                     | 400,000                    | DT LUFTHANSA 3.7500% 11/02/28 EMTN  | 476,976    | 490,407    | 0.09     |
| EUR                     | 400,000                    | CHEPLAPHARM A 3.5000% 11/02/27 REGS | 441,629    | 480,747    | 0.09     |
| EUR                     | 400,000                    | PLATIN 1426 G 5.3750% 15/06/23 REGS | 458,314    | 479,277    | 0.09     |
| EUR                     | 400,000                    | CECONOMY AG 1.7500% 24/06/26        | 473,863    | 472,514    | 0.09     |
| EUR                     | 340,000                    | PLATIN 1426 G 6.8750% 15/06/23 REGS | 384,306    | 406,657    | 0.08     |
| EUR                     | 330,000                    | WEPA HYGIENEP 2.8750% 15/12/27 REGS | 365,246    | 387,824    | 0.07     |
| EUR                     | 300,000                    | KAEFER ISOLIE 5.5000% 10/01/24 REGS | 329,023    | 362,189    | 0.07     |
| EUR                     | 250,000                    | PCF GMBH 4.7500% 15/04/26 REGS      | 299,362    | 303,556    | 0.06     |
| EUR                     | 230,000                    | HAPAG-LLOYD A 2.5000% 15/04/28 REGS | 271,998    | 280,251    | 0.05     |
| EUR                     | 220,000                    | RENK AG 5.7500% 15/07/25 REGS       | 247,786    | 272,347    | 0.05     |
| EUR                     | 200,000                    | ZF FINANCE 3.7500% 21/09/28 EMTN    | 234,440    | 260,494    | 0.05     |
| EUR                     | 200,000                    | TECHEM VERWLT 6.0000% 30/07/26 REGS | 232,960    | 245,168    | 0.05     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨                 | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価       | 評価金額       | 純資産比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------|------------|----------|
| EUR                | 200,000                    | NIDDA BONDCO 7.2500% 30/09/25 REGS  | 233,245    | 244,318    | 0.05     |
| EUR                | 200,000                    | K+S AG 3.0000% 20/06/22 EMTN        | 190,242    | 244,215    | 0.05     |
| EUR                | 200,000                    | THYSSENKRUPP 5.0000% 04/04/22 EMTN  | 241,746    | 240,412    | 0.05     |
| EUR                | 200,000                    | PROGROUP 3.0000% 31/03/26 REGS      | 236,217    | 240,400    | 0.05     |
| EUR                | 200,000                    | DOUGLAS GMBH 6.0000% 08/04/26 REGS  | 235,580    | 237,723    | 0.05     |
| EUR                | 190,000                    | GRUENTHAL G 4.1250% 15/05/28 REGS   | 228,656    | 233,129    | 0.04     |
| USD                | 220,000                    | CHEPLAPHARM A 5.5000% 15/01/28 144A | 226,050    | 225,548    | 0.04     |
| EUR                | 160,000                    | PEACH PROPERT 4.3750% 15/11/25 REGS | 187,992    | 199,604    | 0.04     |
| EUR                | 166,000                    | NIDDA HEALTHC 3.5000% 30/09/24 REGS | 171,027    | 195,698    | 0.04     |
| EUR                | 150,000                    | CHEPLAPHARM A 4.3750% 15/01/28 REGS | 176,528    | 185,433    | 0.04     |
| EUR                | 150,000                    | NOVELIS SHEET 3.3750% 15/04/29 REGS | 177,622    | 183,032    | 0.03     |
| EUR                | 150,000                    | SGL CARBON SE 4.6250% 30/09/24      | 169,980    | 182,085    | 0.03     |
| EUR                | 100,000                    | ADLER REAL EST 3.0000% 27/04/26     | 119,395    | 123,718    | 0.02     |
| EUR                | 100,000                    | TUI CRUISES G 6.5000% 15/05/26 REGS | 120,015    | 123,528    | 0.02     |
| EUR                | 100,000                    | DT LUFTHANSA 3.0000% 29/05/26 EMTN  | 117,802    | 120,041    | 0.02     |
| EUR                | 100,000                    | ZF FINANCE GM 2.0000% 06/05/27 EMTN | 120,760    | 119,605    | 0.02     |
| EUR                | 100,000                    | STYROLUTION 2.2500% 16/01/27 REGS   | 118,146    | 117,450    | 0.02     |
| 合計：ドイツ             |                            |                                     | 14,696,686 | 15,200,766 | 2.88     |
|                    |                            |                                     | 18,797,407 | 19,642,560 | 3.72     |
| <b>ガーナ</b>         |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 800,000                    | GHANA REP OF 8.6250% 07/04/34 REGS  | 814,650    | 826,297    | 0.16     |
| USD                | 200,000                    | GHANA REP OF 8.1250% 26/03/32 REGS  | 202,237    | 202,500    | 0.04     |
| 合計：ガーナ             |                            |                                     | 1,016,887  | 1,028,797  | 0.20     |
|                    |                            |                                     | 1,016,887  | 1,028,797  | 0.20     |
| <b>ギリシャ</b>        |                            |                                     |            |            |          |
| EUR                | 200,000                    | PIRAEUS FRN 16/12/69                | 243,600    | 233,855    | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 243,600    | 233,855    | 0.04     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |            |            |          |
| EUR                | 308,000                    | PUBLIC PWR CORP 3.8750% 30/03/26    | 367,321    | 383,046    | 0.08     |
| 合計：ギリシャ            |                            |                                     | 367,321    | 383,046    | 0.08     |
|                    |                            |                                     | 610,921    | 616,901    | 0.12     |
| <b>グアテマラ</b>       |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 200,000                    | REP OF GUATEM 8.1250% 06/10/34 REGS | 260,000    | 281,000    | 0.05     |
| 合計：グアテマラ           |                            |                                     | 260,000    | 281,000    | 0.05     |
|                    |                            |                                     | 260,000    | 281,000    | 0.05     |
| <b>ガーンジー</b>       |                            |                                     |            |            |          |
| EUR                | 500,000                    | SUMMIT PROPER 2.0000% 31/01/25 144A | 612,000    | 590,587    | 0.11     |
| 合計：ガーンジー           |                            |                                     | 612,000    | 590,587    | 0.11     |
|                    |                            |                                     | 612,000    | 590,587    | 0.11     |
| <b>ホンジュラス</b>      |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 200,000                    | HONDURAS GOVT 5.6250% 24/06/30 REGS | 200,000    | 209,499    | 0.04     |
| 合計：ホンジュラス          |                            |                                     | 200,000    | 209,499    | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 200,000    | 209,499    | 0.04     |
| <b>香港</b>          |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 450,000                    | BANK OF CHINA HK FRN 14/03/70 REGS  | 465,500    | 484,328    | 0.09     |
|                    |                            |                                     | 465,500    | 484,328    | 0.09     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 610,000                    | CNAC HK FINBRID 5.1250% 14/03/28    | 636,872    | 696,206    | 0.14     |
| USD                | 600,000                    | CNAC HK FINBRID 4.8750% 14/03/25    | 596,070    | 657,526    | 0.12     |
| USD                | 600,000                    | CITIC PACIFIC 6.8% 17/01/23 REGS    | 713,893    | 651,659    | 0.12     |
| USD                | 250,000                    | AIA GROUP 3.6000% 09/04/29 REGS     | 248,733    | 277,059    | 0.05     |
| USD                | 235,000                    | AIA GROUP 3.3750% 07/04/30 REGS     | 234,309    | 259,242    | 0.05     |
| USD                | 200,000                    | AIA GROUP 4.5000% 16/03/46 REGS     | 234,948    | 252,621    | 0.05     |
| USD                | 200,000                    | CNAC HK FINBRID 3.0000% 22/09/30    | 199,726    | 197,657    | 0.04     |
| 合計：香港              |                            |                                     | 2,864,551  | 2,991,970  | 0.57     |
|                    |                            |                                     | 3,330,051  | 3,476,298  | 0.66     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨                 | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価      | 評価金額      | 純資産比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|----------|
| <b>ハンガリー</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| <b>国債</b>          |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 100,000                    | REP OF HUNGARY 7.625% 29/03/41      | 139,750   | 164,040   | 0.03     |
|                    |                            |                                     | 139,750   | 164,040   | 0.03     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                | 910,000                    | NITROGENMUVEK 7.0000% 14/05/25 REGS | 1,091,272 | 1,085,699 | 0.21     |
|                    |                            |                                     | 1,091,272 | 1,085,699 | 0.21     |
|                    |                            | 合計：ハンガリー                            | 1,231,022 | 1,249,739 | 0.24     |
| <b>インド</b>         |                            |                                     |           |           |          |
| <b>その他債券</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 300,000                    | JSW HYDRO ENE 4.1250% 18/05/31 REGS | 300,000   | 303,900   | 0.06     |
|                    |                            |                                     | 300,000   | 303,900   | 0.06     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 600,000                    | PERTAMINA PT 6% 03/05/42 REGS       | 655,758   | 734,251   | 0.13     |
| USD                | 520,000                    | BHARTI AIRTEL 4.3750% 10/06/25 REGS | 521,952   | 568,007   | 0.11     |
| USD                | 450,000                    | POWER FIN COR 3.9500% 23/04/30 REGS | 445,676   | 462,939   | 0.09     |
| USD                | 300,000                    | SHRIRAM TRANS 5.1000% 16/07/23 REGS | 300,000   | 305,025   | 0.06     |
| USD                | 200,000                    | OIL INDIA LTD 5.1250% 04/02/29      | 198,304   | 224,071   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | POWER FIN CORP 4.5000% 18/06/29     | 211,300   | 213,980   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | JSW STEEL LTD 5.9500% 18/04/24      | 200,000   | 213,781   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | DELHI INTL AI 6.4500% 04/06/29 REGS | 200,000   | 202,400   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | EX-IM BK OF I 2.2500% 13/01/31 REGS | 185,544   | 185,155   | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 2,918,534 | 3,109,609 | 0.59     |
|                    |                            | 合計：インド                              | 3,218,534 | 3,413,509 | 0.65     |
| <b>インドネシア</b>      |                            |                                     |           |           |          |
| <b>国債</b>          |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 900,000                    | SBSN INDO III 4.4000% 01/03/28 REGS | 901,793   | 1,026,000 | 0.19     |
| USD                | 750,000                    | SBSN INDO III 2.8000% 23/06/30 REGS | 752,399   | 769,283   | 0.15     |
| USD                | 250,000                    | INDONESIA (RE 6.6250% 17/02/37 REGS | 320,313   | 345,505   | 0.07     |
| USD                | 230,000                    | INDONESIA (RE 5.2500% 08/01/47 REGS | 285,428   | 292,684   | 0.06     |
| USD                | 250,000                    | INDONESIA (REP) 4.3500% 11/01/48    | 296,933   | 283,438   | 0.05     |
| USD                | 200,000                    | INDONESIA (RE 5.9500% 08/01/46 REGS | 268,742   | 275,184   | 0.05     |
| USD                | 200,000                    | REP OF INDONESIA 5.125% 15/1/45 REG | 240,875   | 248,070   | 0.05     |
| USD                | 150,000                    | REP OF INDONESIA 7.75% 17/1/38      | 227,399   | 226,884   | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 3,293,882 | 3,467,048 | 0.66     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 515,000                    | INDONESIA ASA 5.4500% 15/05/30 REGS | 536,548   | 598,368   | 0.11     |
| USD                | 400,000                    | PERTAMINA 6.5% 27/05/41             | 422,362   | 515,139   | 0.10     |
| USD                | 350,000                    | PERUSAHAAN GA 5.1250% 16/05/24 REGS | 377,475   | 388,553   | 0.07     |
| USD                | 300,000                    | INDONESIA ASA 6.5300% 15/11/28 REGS | 292,602   | 367,875   | 0.07     |
| USD                | 250,000                    | INDOFOOD CBP SUK 3.3980% 09/06/31   | 250,000   | 253,584   | 0.05     |
| USD                | 200,000                    | INDONESIA REP 4.7500% 18/07/47 REGS | 211,500   | 238,078   | 0.05     |
| USD                | 200,000                    | SBSN INDO III 4.5500% 29/03/26 REGS | 218,750   | 227,000   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | INDOFOOD CBP SUK 4.7450% 09/06/51   | 200,000   | 205,399   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | PERUSAHAAN LISTRIK 5.5% 22/11/21    | 212,338   | 203,140   | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 2,721,575 | 2,997,136 | 0.57     |
|                    |                            | 合計：インドネシア                           | 6,015,457 | 6,464,184 | 1.23     |
| <b>イラク</b>         |                            |                                     |           |           |          |
| <b>国債</b>          |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 335,000                    | REPUBLIC OF I 6.7520% 09/03/23 REGS | 335,000   | 342,119   | 0.06     |
|                    |                            |                                     | 335,000   | 342,119   | 0.06     |
|                    |                            | 合計：イラク                              | 335,000   | 342,119   | 0.06     |
| <b>アイルランド</b>      |                            |                                     |           |           |          |
| <b>変動金利債</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 300,000                    | ALFA BANK FRN 15/04/30 REGS         | 303,000   | 314,459   | 0.06     |
| EUR                | 200,000                    | AIB GROUP PLC FRN 23/12/69          | 226,730   | 270,748   | 0.05     |
| USD                | 210,000                    | BANK OF IRELAND FRN 19/09/27 EMTN   | 208,904   | 214,746   | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 738,634   | 799,953   | 0.15     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 830,000                    | C&W SR FINANC 6.8750% 15/09/27 REGS | 871,531   | 885,734   | 0.16     |
| USD                | 540,000                    | C&W SR FINANC 7.5000% 15/10/26 REGS | 565,383   | 567,000   | 0.11     |
| EUR                | 360,000                    | JAMES HARDIE 3.6250% 01/10/26 REGS  | 422,982   | 438,119   | 0.08     |
| EUR                | 290,000                    | EIRCOM FINANCE 1.7500% 01/11/24     | 319,885   | 345,121   | 0.07     |
| USD                | 200,000                    | KOKS 5.9000% 23/09/25 REGS          | 205,920   | 213,700   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | JAZZ SECURITI 4.3750% 15/01/29 144A | 200,000   | 207,514   | 0.04     |
| USD                | 210,000                    | ENDO DAC/ENDO 6.0000% 30/06/28 144A | 117,170   | 141,615   | 0.03     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨                 | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価      | 評価金額      | 純資産比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|----------|
| USD                | 137,000                    | ENDO DAC/ENDO 9.5000% 31/07/27 144A | 122,892   | 139,740   | 0.03     |
| EUR                | 100,000                    | EIRCOM FINANCE 3.5000% 15/05/26     | 120,681   | 121,802   | 0.02     |
|                    |                            | 合計：アイルランド                           | 2,946,444 | 3,060,345 | 0.58     |
|                    |                            |                                     | 3,685,078 | 3,860,298 | 0.73     |
| <b>マン島</b>         |                            |                                     |           |           |          |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                | 300,000                    | PLAYTECH PLC 3.7500% 12/10/23       | 345,180   | 361,850   | 0.07     |
|                    |                            | 合計：マン島                              | 345,180   | 361,850   | 0.07     |
|                    |                            |                                     | 345,180   | 361,850   | 0.07     |
| <b>イスラエル</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| <b>変動金利債</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 200,000                    | BANK LEUMI ISRL FRN 29/01/31        | 206,500   | 206,000   | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 206,500   | 206,000   | 0.04     |
| <b>その他債券</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 200,000                    | MIZRAHI TEFAHOT FRN 07/04/31        | 202,350   | 202,000   | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 202,350   | 202,000   | 0.04     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 450,000                    | LEVIATHAN BOND 6.7500% 30/06/30     | 468,450   | 507,374   | 0.09     |
| USD                | 480,000                    | ENERGEAN ISRAEL 5.8750% 30/03/31    | 480,000   | 492,960   | 0.09     |
| USD                | 270,000                    | LEVIATHAN BOND 6.5000% 30/06/27     | 285,212   | 299,700   | 0.06     |
| USD                | 175,000                    | LEVIATHAN BOND 6.1250% 30/06/25     | 178,906   | 192,281   | 0.04     |
| USD                | 60,000                     | LEVIATHAN BOND 5.7500% 30/06/23     | 60,653    | 62,714    | 0.01     |
| USD                | 50,000                     | ENERGEAN ISRAEL 5.3750% 30/03/28    | 50,000    | 51,318    | 0.01     |
| USD                | 35,000                     | ICL GROUP LTD 6.3750% 31/05/38      | 35,037    | 44,450    | 0.01     |
|                    |                            | 合計：イスラエル                            | 1,558,258 | 1,650,797 | 0.31     |
|                    |                            |                                     | 1,967,108 | 2,058,797 | 0.39     |
| <b>イタリア</b>        |                            |                                     |           |           |          |
| <b>転換社債</b>        |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                | 200,000                    | TELECOM ITALIA CV 1.125% 26/03/22   | 241,794   | 238,672   | 0.04     |
| EUR                | 100,000                    | NEXI CV 1.7500% 24/04/27            | 108,730   | 146,565   | 0.03     |
|                    |                            |                                     | 350,524   | 385,237   | 0.07     |
| <b>変動金利債</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                | 760,000                    | UNICREDIT SPA FRN 15/01/32          | 849,126   | 924,398   | 0.17     |
| EUR                | 500,000                    | UNICREDIT SPA FRN 03/06/70          | 618,657   | 636,801   | 0.12     |
| USD                | 500,000                    | UNICREDIT SPA FRN 31/12/50          | 500,000   | 556,098   | 0.11     |
| EUR                | 400,000                    | INTESA SANPAOLO FRN 20/06/70 EMTN   | 494,790   | 524,232   | 0.10     |
| EUR                | 350,000                    | UNICREDIT SPA FRN 03/06/70          | 388,741   | 493,698   | 0.09     |
| EUR                | 307,000                    | BANCO BPM SPA FRN 19/07/69          | 372,805   | 399,368   | 0.08     |
| EUR                | 290,000                    | INTESA SANPAOLO FRN 01/03/70 EMTN   | 342,490   | 379,642   | 0.07     |
| EUR                | 300,000                    | MEDIOBANCA SPA FRN 23/11/30 EMTN    | 369,602   | 363,014   | 0.07     |
| EUR                | 300,000                    | UNICREDIT SPA FRN 29/09/49          | 393,810   | 360,975   | 0.07     |
| EUR                | 300,000                    | ITALMATCH CHEMIC FRN 30/09/24 REGS  | 326,539   | 343,796   | 0.07     |
| EUR                | 300,000                    | EVOCA SPA FRN 01/11/26 REGS         | 346,821   | 336,501   | 0.06     |
| EUR                | 200,000                    | UNICREDIT SPA FRN 03/12/69          | 262,192   | 255,872   | 0.05     |
| EUR                | 205,000                    | MONTE DEI PASCHI FRN 22/01/30       | 228,216   | 222,745   | 0.04     |
| EUR                | 220,000                    | MONTE DEI PASCHI FRN 18/01/28 EMTN  | 194,890   | 214,694   | 0.04     |
| EUR                | 145,000                    | POSTE ITALIANE FRN 24/06/70         | 175,820   | 172,392   | 0.03     |
| EUR                | 130,000                    | GOLDEN GOOSE SPA FRN 14/05/27 REGS  | 153,740   | 151,751   | 0.03     |
|                    |                            |                                     | 6,018,239 | 6,335,977 | 1.20     |
| <b>その他債券</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                | 600,000                    | INTER MEDIA C 4.8750% 31/12/22 REGS | 671,530   | 673,475   | 0.13     |
| EUR                | 200,000                    | DIOCLE SPA FRN 30/06/26 REGS        | 203,362   | 214,411   | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 874,892   | 887,886   | 0.17     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                | 843,000                    | NEXI 2.1250% 30/04/29               | 1,009,596 | 992,820   | 0.20     |
| EUR                | 800,000                    | AUTOSTRADA PE 1.8750% 26/09/29 EMTN | 914,048   | 981,118   | 0.19     |
| EUR                | 700,000                    | INTL DESIGN G 6.5000% 15/11/25 REGS | 740,319   | 869,815   | 0.16     |
| EUR                | 700,000                    | PRO-GEST SPA 3.2500% 15/12/24 REGS  | 703,157   | 798,914   | 0.15     |
| EUR                | 500,000                    | CENTURION BID 5.8750% 30/09/26 REGS | 590,191   | 621,170   | 0.12     |
| EUR                | 440,000                    | ALMAVIVA 7.2500% 15/10/22 REGS      | 516,274   | 533,594   | 0.10     |
| EUR                | 432,000                    | AUTOSTRADA PER L 2.0000% 15/01/30   | 518,330   | 530,833   | 0.10     |
| EUR                | 400,000                    | WEBUILD SPA 5.8750% 15/12/25        | 489,155   | 526,561   | 0.10     |
| EUR                | 400,000                    | GAMMA BIDCO S 6.2500% 15/07/25 REGS | 462,851   | 501,984   | 0.10     |
| EUR                | 400,000                    | ROSSINI SARL 6.7500% 30/10/25 REGS  | 464,160   | 498,415   | 0.09     |
| EUR                | 404,000                    | INFRASTRUTTUR 1.6250% 21/10/28 GMTN | 478,748   | 489,432   | 0.09     |
| EUR                | 340,000                    | REKEEP SPA 7.2500% 01/02/26 REGS    | 412,811   | 435,508   | 0.08     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨          | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価       | 評価金額       | 純資産比率(%) |
|-------------|----------------------------|-------------------------------------|------------|------------|----------|
| EUR         | 330,000                    | MARCOLIN 6.1250% 15/11/26 REGS      | 403,755    | 399,606    | 0.08     |
| EUR         | 300,000                    | DOBANK SPA 5.0000% 04/08/25 REGS    | 352,823    | 373,778    | 0.07     |
| EUR         | 300,000                    | AUTOSTRADE PE 1.7500% 26/06/26 EMTN | 349,347    | 368,962    | 0.07     |
| EUR         | 240,000                    | GUALA CLOSURE 3.2500% 15/06/28 REGS | 285,828    | 286,510    | 0.05     |
| EUR         | 200,000                    | WEBUILD 3.6250% 28/01/27            | 213,106    | 246,426    | 0.05     |
| GBP         | 150,000                    | AUTOSTRADE PE 6.2500% 09/06/22 EMTN | 203,267    | 217,027    | 0.04     |
| EUR         | 180,000                    | IMA INDUSTRIA 3.7500% 15/01/28 REGS | 217,746    | 215,075    | 0.04     |
| USD         | 200,000                    | F-BRASILE SPA/F 7.3750% 15/08/26 XR | 200,000    | 205,998    | 0.04     |
| EUR         | 150,000                    | AUTOSTRADE PER L 2.0000% 04/12/28   | 186,924    | 185,745    | 0.04     |
| EUR         | 150,000                    | TELECOM ITALI 2.3750% 12/10/27 EMTN | 174,895    | 185,705    | 0.04     |
| EUR         | 150,000                    | GAMMA BIDCO S 5.1250% 15/07/25 REGS | 179,475    | 184,120    | 0.03     |
| EUR         | 150,000                    | NEXI 1.7500% 31/10/24               | 165,232    | 182,048    | 0.03     |
| EUR         | 100,000                    | MONTE DEI PA 10.5000% 23/07/29 EMTN | 129,488    | 133,218    | 0.03     |
| EUR         | 100,000                    | TELECOM ITALI 2.8750% 28/01/26 EMTN | 111,195    | 126,332    | 0.02     |
| EUR         | 100,000                    | PIAGGIO & C 3.6250% 30/04/25 REGS   | 117,228    | 121,093    | 0.02     |
| EUR         | 100,000                    | BRUNELLO BIDC 3.5000% 15/02/28 REGS | 121,570    | 119,001    | 0.02     |
|             |                            | 合計：イタリア                             | 10,711,519 | 11,330,808 | 2.15     |
|             |                            |                                     | 17,955,174 | 18,939,908 | 3.59     |
|             |                            | <b>ジャマイカ</b>                        |            |            |          |
| 国債          |                            |                                     |            |            |          |
| USD         | 200,000                    | JAMAICA GVT 7.875% 28/07/45         | 245,534    | 279,500    | 0.05     |
|             |                            |                                     | 245,534    | 279,500    | 0.05     |
|             |                            | 合計：ジャマイカ                            | 245,534    | 279,500    | 0.05     |
|             |                            | <b>日本</b>                           |            |            |          |
| 変動金利債       |                            |                                     |            |            |          |
| EUR         | 600,000                    | RAKUTEN GROUP FRN 22/04/70 REGS     | 725,206    | 735,482    | 0.14     |
|             |                            |                                     | 725,206    | 735,482    | 0.14     |
| 普通社債(固定金利債) |                            |                                     |            |            |          |
| EUR         | 700,000                    | SOFTBANK GRP COR 4.0000% 19/09/29   | 836,850    | 878,456    | 0.17     |
|             |                            |                                     | 836,850    | 878,456    | 0.17     |
|             |                            | 合計：日本                               | 1,562,056  | 1,613,938  | 0.31     |
|             |                            | <b>ジャージー</b>                        |            |            |          |
| その他債券       |                            |                                     |            |            |          |
| USD         | 200,000                    | GALAXY PIPELI 3.2500% 30/09/40 REGS | 206,400    | 198,595    | 0.04     |
| USD         | 200,000                    | GALAXY PIPELI 2.9400% 30/09/40 REGS | 199,600    | 198,515    | 0.04     |
|             |                            |                                     | 406,000    | 397,110    | 0.08     |
| 普通社債(固定金利債) |                            |                                     |            |            |          |
| EUR         | 1,000,000                  | MAIN CAPITAL FDG 5.5% 29/06/49      | 873,478    | 1,248,166  | 0.23     |
| GBP         | 500,000                    | AA BOND CO LT 6.5000% 31/01/26 REGS | 703,760    | 717,233    | 0.14     |
| EUR         | 300,000                    | ADIENT GLB HDGS 3.5% 15/08/24 REGS  | 312,927    | 367,027    | 0.07     |
| GBP         | 200,000                    | CPUK FINANCE 4.8750% 28/08/25 REGS  | 277,898    | 279,916    | 0.05     |
| USD         | 200,000                    | ORIFLAME INVE 5.1250% 04/05/26 REGS | 200,800    | 205,060    | 0.04     |
|             |                            |                                     | 2,368,863  | 2,817,402  | 0.53     |
|             |                            | 合計：ジャージー                            | 2,774,863  | 3,214,512  | 0.61     |
|             |                            | <b>ヨルダン</b>                         |            |            |          |
| 国債          |                            |                                     |            |            |          |
| USD         | 200,000                    | JORDAN 5.8500% 07/07/30 REGS        | 200,000    | 208,002    | 0.04     |
|             |                            |                                     | 200,000    | 208,002    | 0.04     |
|             |                            | 合計：ヨルダン                             | 200,000    | 208,002    | 0.04     |
|             |                            | <b>カザフスタン</b>                       |            |            |          |
| 国債          |                            |                                     |            |            |          |
| USD         | 200,000                    | REP KAZAKHSTAN 6.5% 21/07/45 REGS   | 227,889    | 292,200    | 0.06     |
|             |                            |                                     | 227,889    | 292,200    | 0.06     |
| 普通社債(固定金利債) |                            |                                     |            |            |          |
| USD         | 300,000                    | KAZMUNAYGAS N 6.3750% 24/10/48 REGS | 297,015    | 397,241    | 0.07     |
|             |                            |                                     | 297,015    | 397,241    | 0.07     |
|             |                            | 合計：カザフスタン                           | 524,904    | 689,441    | 0.13     |
|             |                            | <b>ケニア</b>                          |            |            |          |
| 国債          |                            |                                     |            |            |          |
| USD         | 300,000                    | KENYA REP OF 7.2500% 28/02/28 REGS  | 300,000    | 331,128    | 0.06     |
|             |                            |                                     | 300,000    | 331,128    | 0.06     |
|             |                            | 合計：ケニア                              | 300,000    | 331,128    | 0.06     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨                      | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                  | 取得時価      | 評価金額      | 純資産比率(%) |
|-------------------------|----------------------------|--------------------------------------|-----------|-----------|----------|
| <b>変動金利債</b>            |                            |                                      |           |           |          |
| <b>クウェート</b>            |                            |                                      |           |           |          |
| USD                     | 300,000                    | BURGAN BANK FRN 31/12/69             | 300,000   | 303,308   | 0.06     |
|                         |                            | 合計：クウェート                             | 300,000   | 303,308   | 0.06     |
| <b>国債</b>               |                            |                                      |           |           |          |
| <b>レバノン</b>             |                            |                                      |           |           |          |
| USD                     | 481,000                    | LEBANESE REP 8.2500% 12/04/21 REGS   | 429,555   | 61,328    | 0.01     |
| USD                     | 296,000                    | LEBANESE REP 6.1000% 04/10/22 EMTN   | 204,291   | 37,740    | 0.01     |
| USD                     | 237,000                    | LEBANESE REP 6.3750% 09/03/20 GMTN   | 212,339   | 29,921    | 0.01     |
| USD                     | 188,000                    | LEBANESE REP 6.8500% 23/03/27        | 136,029   | 23,500    | 0.00     |
| USD                     | 161,000                    | LEBANESE REP 5.8000% 14/04/20        | 123,711   | 20,326    | 0.00     |
| USD                     | 129,000                    | LEBANESE REP 7.0000% 23/03/32 15YR   | 104,174   | 16,125    | 0.00     |
| USD                     | 71,000                     | LEBANESE REP 7.2500% 23/03/37        | 54,656    | 9,230     | 0.00     |
| USD                     | 14,000                     | LEBANESE REP 6.6000% 27/11/26 GMTN   | 14,326    | 1,750     | 0.00     |
|                         |                            |                                      | 1,279,081 | 199,920   | 0.03     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b>      |                            |                                      |           |           |          |
| USD                     | 784,000                    | LEBANESE REP 7.0500% 02/11/35 GMTN   | 370,220   | 98,229    | 0.02     |
| USD                     | 284,000                    | LEBANESE REP 6.1500% 19/06/20 GMTN   | 231,019   | 35,557    | 0.01     |
|                         |                            | 合計：レバノン                              | 601,239   | 133,786   | 0.03     |
|                         |                            |                                      | 1,880,320 | 333,706   | 0.06     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b>      |                            |                                      |           |           |          |
| <b>リベリア</b>             |                            |                                      |           |           |          |
| USD                     | 455,000                    | ROYAL CARIBBE 5.5000% 01/04/28 144A  | 457,106   | 478,318   | 0.09     |
| USD                     | 395,000                    | ROYAL CARIBBEAN 3.7000% 15/03/28     | 344,450   | 377,260   | 0.07     |
| USD                     | 175,000                    | ROYAL CARIBBE 9.1250% 15/06/23 144A  | 178,000   | 192,063   | 0.04     |
| USD                     | 150,000                    | ROYAL CARIBBEAN 5.2500% 15/11/22     | 135,000   | 154,121   | 0.03     |
|                         |                            | 合計：リベリア                              | 1,114,556 | 1,201,762 | 0.23     |
|                         |                            |                                      | 1,114,556 | 1,201,762 | 0.23     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b>      |                            |                                      |           |           |          |
| <b>リトアニア</b>            |                            |                                      |           |           |          |
| EUR                     | 450,000                    | AKROPOLIS GROUP 2.8750% 02/06/26     | 548,611   | 526,398   | 0.10     |
|                         |                            | 合計：リトアニア                             | 548,611   | 526,398   | 0.10     |
|                         |                            |                                      | 548,611   | 526,398   | 0.10     |
| <b>転換社債</b>             |                            |                                      |           |           |          |
| <b>ルクセンブルグ</b>          |                            |                                      |           |           |          |
| EUR                     | 300,000                    | CORESTATE CV 1.3750% 28/11/22 CCAP   | 305,369   | 299,905   | 0.06     |
|                         |                            |                                      | 305,369   | 299,905   | 0.06     |
| <b>変動金利債</b>            |                            |                                      |           |           |          |
| EUR                     | 101,000                    | CIRSA FINANCE IN FRN 30/09/25 REGS   | 113,044   | 117,796   | 0.02     |
|                         |                            |                                      | 113,044   | 117,796   | 0.02     |
| <b>その他債券</b>            |                            |                                      |           |           |          |
| EUR                     | 500,000                    | SUMMER BC HOL 9.2500% 31/10/27 REGS  | 554,809   | 581,077   | 0.11     |
| USD                     | 420,000                    | MILLICOM INTL 5.1250% 15/01/28 REGS  | 380,279   | 393,120   | 0.07     |
| USD                     | 200,000                    | MILLICOM INTL 6.6250% 15/10/26 REGS  | 180,000   | 190,350   | 0.04     |
| USD                     | 200,000                    | ECUADOR SOC BON 0% 30/01/35 REGS     | 121,209   | 145,025   | 0.03     |
| EUR                     | 400,000                    | GALAPAGOS SA FRN 15/06/21 REGS       | 39,977    | 904       | 0.00     |
| EUR                     | 200,000                    | GALAPAGOS SA 5.3750% 15/06/21 REGS   | 21,700    | 252       | 0.00     |
|                         |                            |                                      | 1,297,974 | 1,310,728 | 0.25     |
| <b>バイ・イン・カインド(PIK)債</b> |                            |                                      |           |           |          |
| EUR                     | 486,000                    | LSF9 BALTA ISSUE PIK 31/12/24 REGS   | 561,777   | 583,016   | 0.11     |
| USD                     | 470,000                    | ARD FINANCE SA PIK 30/06/27 144A     | 463,700   | 492,325   | 0.09     |
| EUR                     | 116,320                    | LHMC FINCO 2 PIK 02/10/25 REGS       | 118,998   | 137,948   | 0.03     |
|                         |                            |                                      | 1,144,475 | 1,213,289 | 0.23     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b>      |                            |                                      |           |           |          |
| EUR                     | 1,816,000                  | OLIVETTI FINA 7.7500% 24/01/33 EMTN  | 2,968,663 | 3,163,489 | 0.59     |
| EUR                     | 1,212,000                  | LINCOLN FIN 3.6250% 01/04/24 REGS    | 1,380,753 | 1,457,304 | 0.27     |
| EUR                     | 1,200,000                  | VIVION 3.0000% 08/08/24              | 1,324,225 | 1,420,265 | 0.26     |
| EUR                     | 800,000                    | CIRSA FINANCE 6.2500% 20/12/23 REGS  | 926,522   | 965,562   | 0.17     |
| EUR                     | 698,000                    | CLIDRON AIDA F 5.0000% 01/04/28 REGS | 845,014   | 842,112   | 0.16     |
| EUR                     | 600,000                    | CRYSTAL ALMON 4.2500% 15/10/24 REGS  | 661,814   | 730,127   | 0.14     |
| USD                     | 525,000                    | KLABIN AUSTRI 7.0000% 03/04/49 REGS  | 580,935   | 667,412   | 0.13     |
| USD                     | 640,000                    | SIMPAR EUROPE 5.2000% 26/01/31 REGS  | 639,994   | 656,966   | 0.12     |
| USD                     | 600,000                    | ALTICE FIN SA 7.5% 15/05/26 REGS     | 626,587   | 624,990   | 0.12     |
| USD                     | 550,000                    | ALTICE FRANC 10.5000% 15/05/27 144A  | 562,329   | 611,188   | 0.12     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨                 | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価       | 評価金額       | 純資産比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------|------------|----------|
| EUR                | 450,000                    | MONITCHEM HOL 9.5000% 15/09/26 REGS | 493,596    | 580,397    | 0.11     |
| EUR                | 500,000                    | ADLER GROUP SA 2.2500% 14/01/29     | 597,854    | 576,455    | 0.11     |
| EUR                | 463,000                    | GARFUNKELUX H 6.7500% 01/11/25 REGS | 562,785    | 573,939    | 0.11     |
| EUR                | 450,000                    | SUMMER BC HOL 5.7500% 31/10/26 REGS | 500,423    | 560,229    | 0.11     |
| EUR                | 423,000                    | DANA FIN LUX 3.0000% 15/07/29 REGS  | 513,443    | 515,998    | 0.10     |
| USD                | 455,000                    | CONNECT FINCO 6.7500% 01/10/26 144A | 466,250    | 481,608    | 0.09     |
| EUR                | 400,000                    | ADLER GROUP SA 2.7500% 13/11/26     | 469,854    | 481,396    | 0.09     |
| USD                | 400,000                    | GAZPROM 5.1500% 11/02/26 REGS       | 421,029    | 449,846    | 0.09     |
| USD                | 400,000                    | MHP SA 7.75% 10/05/24 REGS          | 422,300    | 433,824    | 0.08     |
| EUR                | 355,000                    | CIRSA FINANCE 4.7500% 22/05/25 REGS | 400,071    | 424,070    | 0.08     |
| USD                | 400,000                    | REDE D'OR FIN 4.5000% 22/01/30 REGS | 400,000    | 408,520    | 0.08     |
| USD                | 400,000                    | ALTICE FRANCE 6.0000% 15/02/28 144A | 378,020    | 397,800    | 0.08     |
| USD                | 400,000                    | MINERVA LUX S 4.3750% 18/03/31 REGS | 396,008    | 396,500    | 0.08     |
| EUR                | 300,000                    | HSE FINANCE S 5.6250% 15/10/26 REGS | 360,720    | 367,063    | 0.07     |
| USD                | 330,000                    | MOVIDA EUROPE 5.2500% 08/02/31 REGS | 330,000    | 332,970    | 0.06     |
| USD                | 290,000                    | OJSC RUSS AGRIC BK 8.5% 16/10/23 RE | 326,613    | 327,758    | 0.06     |
| USD                | 300,000                    | CSN RESOURCES 7.6250% 17/04/26 REGS | 296,022    | 323,250    | 0.06     |
| USD                | 300,000                    | JBS FINANCE L 3.6250% 15/01/32 REGS | 296,739    | 300,000    | 0.06     |
| GBP                | 206,000                    | GARFUNKELUX H 7.7500% 01/11/25 REGS | 269,088    | 296,611    | 0.06     |
| EUR                | 240,000                    | PLT VII FINAN 4.6250% 05/01/26 REGS | 278,990    | 294,787    | 0.06     |
| EUR                | 240,000                    | TRAFIGURA FUN 3.8750% 02/02/26 EMTN | 291,108    | 293,722    | 0.06     |
| USD                | 270,000                    | PUMA INTERNAT 5.0000% 24/01/26 REGS | 267,975    | 270,675    | 0.05     |
| USD                | 250,000                    | PETRRIO LUX 6.1250% 09/06/26 REGS   | 250,000    | 255,000    | 0.05     |
| EUR                | 200,000                    | MONITCHEM HOL 5.2500% 15/03/25 REGS | 219,531    | 245,161    | 0.05     |
| EUR                | 190,000                    | FLAMINGO LUX 5.0000% 31/03/29 REGS  | 226,328    | 224,489    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | VTB CAPITAL 6.95% 17/10/22 REGS     | 191,200    | 211,356    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | AMAGGI LUX IN 5.2500% 28/01/28 REGS | 200,000    | 209,702    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | CAMELOT FINAN 4.5000% 01/11/26 144A | 200,000    | 209,250    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | ALTICE FINANCING 7.5% 15/05/26 144A | 211,000    | 208,330    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | JSM GLOBAL SA 4.7500% 20/10/30 REGS | 199,996    | 207,428    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | MILLICOM INTL 4.5000% 27/04/31 REGS | 200,000    | 207,000    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | B2W DIGITAL L 4.3750% 20/12/30 REGS | 206,200    | 200,400    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | ALTICE FINANC 5.0000% 15/01/28 144A | 200,000    | 196,034    | 0.04     |
| EUR                | 160,000                    | CONTOURGLOB P 3.1250% 01/01/28 REGS | 193,552    | 192,780    | 0.04     |
| USD                | 185,000                    | TR OP / TR FI 5.1250% 01/04/29 144A | 185,000    | 189,163    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | FOUR FINANCE SA 10.75% 01/05/22 144 | 200,000    | 188,750    | 0.04     |
| USD                | 155,000                    | VENATOR FIN S 9.5000% 01/07/25 144A | 151,912    | 174,181    | 0.03     |
| USD                | 150,000                    | TELECOM ITALIA CAP 6% 30/09/34      | 153,628    | 174,000    | 0.03     |
| USD                | 165,000                    | CONS ENERGY F 6.8750% 15/06/25 144A | 133,778    | 168,081    | 0.03     |
| USD                | 275,000                    | INTELSAT JACK 9.7500% 15/07/25 144A | 276,321    | 160,188    | 0.03     |
| GBP                | 110,000                    | CIDRON AIDA F 6.2500% 01/04/28 REGS | 152,750    | 155,189    | 0.03     |
| EUR                | 101,000                    | BK LC FINCO 1 5.2500% 30/04/29 REGS | 121,942    | 122,905    | 0.02     |
| EUR                | 100,000                    | KLEOPATRA FIN 4.2500% 01/03/26 REGS | 120,150    | 119,468    | 0.02     |
| EUR                | 100,000                    | KLEOPATRA HLD 6.5000% 01/09/26 REGS | 120,150    | 115,784    | 0.02     |
| USD                | 115,000                    | VENATOR FIN S 5.7500% 15/07/25 144A | 102,202    | 112,988    | 0.02     |
| USD                | 100,000                    | ENDO LUX FIN 6.1250% 01/04/29 144A  | 100,000    | 98,000     | 0.02     |
| USD                | 75,000                     | INTELSAT JACK 8% 15/02/24 144A      | 76,313     | 77,458     | 0.01     |
| USD                | 100,000                    | MALLINCKRODT FIN 5.625% 15/10/23 14 | 86,625     | 70,000     | 0.01     |
| USD                | 20,000                     | GAZPROM 8.6250% 28/04/34 REGS       | 29,435     | 29,820     | 0.01     |
| USD                | 25,000                     | MALLINCKRODT FIN 5.75% 1/8/22 144A  | 21,125     | 17,438     | 0.00     |
| USD                | 375,000                    | INTELSAT LUX 8.125% 01/06/23        | 265,020    | 11,156     | 0.00     |
| EUR                | 1,154,000                  | IIB LUX 9% 06/07/11                 | 1,350,997  | 2,747      | 0.00     |
| 合計：ルクセンブルグ         |                            |                                     | 25,400,879 | 24,781,079 | 4.69     |
|                    |                            |                                     | 28,261,741 | 27,722,797 | 5.25     |
| <b>マレーシア</b>       |                            |                                     |            |            |          |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 415,000                    | PETRONAS CAP 3.5000% 21/04/30 REGS  | 409,754    | 454,577    | 0.08     |
| USD                | 300,000                    | PETRONAS CAP 2.4800% 28/01/32 REGS  | 299,949    | 301,447    | 0.06     |
| USD                | 200,000                    | PETRONAS CAP 3.4040% 28/04/61 REGS  | 200,000    | 204,218    | 0.04     |
| 合計：マレーシア           |                            |                                     | 909,703    | 960,242    | 0.18     |
|                    |                            |                                     | 909,703    | 960,242    | 0.18     |
| <b>マルタ</b>         |                            |                                     |            |            |          |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 300,000                    | VISTAJET MAL 10.5000% 01/06/24 144A | 285,107    | 327,060    | 0.06     |
| 合計：マルタ             |                            |                                     | 285,107    | 327,060    | 0.06     |
|                    |                            |                                     | 285,107    | 327,060    | 0.06     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨                 | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                  | 取得時価      | 評価金額      | 純資産比率(%) |
|--------------------|----------------------------|--------------------------------------|-----------|-----------|----------|
| <b>マーシャル諸島</b>     |                            |                                      |           |           |          |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                      |           |           |          |
| USD                | 470,000                    | OCP SA 6.875% 25/04/44 REGS          | 559,323   | 572,197   | 0.11     |
|                    |                            |                                      | 559,323   | 572,197   | 0.11     |
|                    |                            | 合計：マーシャル諸島                           | 559,323   | 572,197   | 0.11     |
| <b>モーリシャス</b>      |                            |                                      |           |           |          |
| <b>変動金利債</b>       |                            |                                      |           |           |          |
| USD                | 760,000                    | NETWORK 121 LTD FRN 03/06/70 REGS    | 759,873   | 760,380   | 0.14     |
|                    |                            |                                      | 759,873   | 760,380   | 0.14     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                      |           |           |          |
| USD                | 550,000                    | GREENKO SOLAR 5.5500% 29/01/25 REGS  | 550,000   | 565,303   | 0.11     |
| USD                | 250,000                    | GREENKO SOLAR 5.9500% 29/07/26 REGS  | 250,000   | 269,164   | 0.05     |
| USD                | 250,000                    | MTN MAURITIUS 4.755% 11/11/24 REGS   | 225,575   | 266,823   | 0.05     |
| USD                | 250,000                    | INDIA GREEN E 5.3750% 29/04/24 REGS  | 257,375   | 261,625   | 0.05     |
|                    |                            |                                      | 1,282,950 | 1,362,915 | 0.26     |
|                    |                            | 合計：モーリシャス                            | 2,042,823 | 2,123,295 | 0.40     |
| <b>メキシコ</b>        |                            |                                      |           |           |          |
| <b>変動金利債</b>       |                            |                                      |           |           |          |
| EUR                | 800,000                    | PETROLEOS MEXICA FRN 24/08/23        | 706,381   | 948,548   | 0.18     |
| USD                | 500,000                    | GRUPO BIMBO SAB FRN 17/07/69 REGS    | 499,583   | 527,350   | 0.10     |
| USD                | 375,000                    | BBVA BANCOMER SA FRN 18/01/33 REGS   | 366,981   | 390,750   | 0.07     |
|                    |                            |                                      | 1,572,945 | 1,866,648 | 0.35     |
| <b>国債</b>          |                            |                                      |           |           |          |
| USD                | 890,000                    | UTD MEXICAN STATE 6.05% 11/01/40     | 1,074,616 | 1,119,606 | 0.22     |
| USD                | 500,000                    | UNITED MEXICAN 4.2800% 14/08/41      | 499,689   | 528,685   | 0.10     |
| USD                | 200,000                    | UNITED MEXICAN 5.0000% 27/04/51      | 192,202   | 227,177   | 0.04     |
| USD                | 232,000                    | UNITED MEXICAN 3.7710% 24/05/61      | 219,219   | 218,060   | 0.04     |
| USD                | 148,000                    | UTD MEXICAN STATES 5.75% 12/10/2110  | 154,140   | 176,603   | 0.03     |
| USD                | 108,000                    | UTD MEXICAN STATE 4.75% 8/3/44 MTN   | 111,043   | 118,654   | 0.02     |
| USD                | 95,000                     | UNITED MEXICAN STATE 5.55% 21/01/45  | 105,856   | 114,467   | 0.02     |
|                    |                            |                                      | 2,356,765 | 2,503,252 | 0.47     |
| <b>その他債券</b>       |                            |                                      |           |           |          |
| USD                | 200,000                    | COMETA ENERGI 6.3750% 24/04/35 REGS  | 164,520   | 209,991   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | MEXICO GENERA 5.5000% 06/12/32 REGS  | 175,743   | 169,232   | 0.03     |
|                    |                            |                                      | 340,263   | 379,223   | 0.07     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                      |           |           |          |
| USD                | 2,078,000                  | PETROLEOS MEXICA 7.6900% 23/01/50    | 2,037,467 | 2,002,153 | 0.39     |
| USD                | 1,200,000                  | PETROLEOS MEXICA 5.9500% 28/01/31    | 1,186,209 | 1,167,000 | 0.23     |
| USD                | 1,050,000                  | PETROLEOS MEXICA 6.4900% 23/01/27    | 1,026,145 | 1,104,915 | 0.22     |
| EUR                | 800,000                    | PEMEX PROJ FDG MAS 5.5% 24/02/25 RE  | 934,135   | 1,042,660 | 0.20     |
| USD                | 917,000                    | PEMEX 6.75% 21/09/47                 | 757,871   | 808,812   | 0.15     |
| USD                | 650,000                    | TRUST FIBRA1 6.3900% 15/01/50 REGS   | 657,656   | 760,507   | 0.14     |
| USD                | 625,000                    | PETROLEOS MEX 6.8750% 16/10/25 REGS  | 623,050   | 691,875   | 0.13     |
| USD                | 500,000                    | SANTANDER MEX 5.3750% 17/04/25 REGS  | 500,000   | 567,320   | 0.11     |
| USD                | 360,000                    | INDUSTRIAS PE 5.6500% 12/09/49 REGS  | 359,950   | 432,450   | 0.08     |
| USD                | 405,000                    | AXTEL SAB 6.3750% 14/11/24 REGS      | 419,033   | 421,605   | 0.08     |
| USD                | 400,000                    | METALSA SA DE 3.7500% 04/05/31 REGS  | 397,160   | 395,000   | 0.07     |
| USD                | 490,000                    | AEROVIAS MEXI 7.0000% 05/02/25 REGS  | 490,000   | 383,430   | 0.07     |
| USD                | 350,000                    | UNIFIN FINANC 9.8750% 28/01/29 REGS  | 350,000   | 343,004   | 0.07     |
| USD                | 300,000                    | MINERA MEXICO 4.5000% 26/01/50 REGS  | 296,199   | 337,500   | 0.06     |
| USD                | 300,000                    | TRUST F/1401 5.2500% 30/01/26 144A   | 329,094   | 337,500   | 0.06     |
| EUR                | 300,000                    | PETROLEOS MEX 2.7500% 21/04/27 EMTN  | 273,319   | 332,824   | 0.06     |
| USD                | 300,000                    | CEMEX SAB 5.4500% 19/11/29 REGS      | 305,580   | 329,850   | 0.06     |
| USD                | 300,000                    | ALPEK SA DE C 4.2500% 18/09/29 REGS  | 299,154   | 325,128   | 0.06     |
| EUR                | 260,000                    | PETROLEOS MEX 4.7500% 26/02/29 10.7  | 237,598   | 306,734   | 0.06     |
| USD                | 300,000                    | ORBITA ADVANCE 1.8750% 11/05/26 REGS | 299,673   | 301,875   | 0.06     |
| USD                | 300,000                    | ORBITA ADVANCE 2.8750% 11/05/31 REGS | 296,448   | 301,500   | 0.06     |
| USD                | 200,000                    | ALFA S.A. 6.8750% 25/03/44 REGS      | 188,200   | 263,502   | 0.05     |
| USD                | 200,000                    | TRUST FIBRA1 4.8690% 15/01/30 REGS   | 220,020   | 220,160   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | CEMEX SAB 5.4500% 19/11/29 144A      | 200,000   | 219,900   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | PETROLEOS MEXICA 6.5000% 13/03/27    | 181,700   | 210,840   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | CEMEX SAB 3.8750% 11/07/31 REGS      | 200,000   | 203,200   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | CEMEX SAB 3.8750% 11/07/31 144A      | 200,000   | 203,200   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | INFRASTRUCTU 4.7500% 15/01/51 REGS   | 198,800   | 202,500   | 0.04     |
| USD                | 224,000                    | PETROLEOS MEXICA 6.9500% 28/01/60    | 186,260   | 198,374   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | UNITED MEXICA 3.7500% 19/04/71 EMTN  | 191,250   | 183,092   | 0.03     |
| EUR                | 140,000                    | PETROLEOS MEX 5.1250% 15/03/23 EMTN  | 137,241   | 175,241   | 0.03     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨                      | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価       | 評価金額       | 純資産比率(%) |
|-------------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------|------------|----------|
| USD                     | 104,000                    | PETROLEOS MEXICA 6.3500% 12/02/48   | 87,727     | 88,629     | 0.02     |
|                         |                            | 合計：メキシコ                             | 14,066,939 | 14,862,280 | 2.83     |
|                         |                            |                                     | 18,336,912 | 19,611,403 | 3.72     |
| <b>モンゴル</b>             |                            |                                     |            |            |          |
| 国債                      |                            |                                     |            |            |          |
| USD                     | 300,000                    | MONGOLIA INTL 5.6250% 01/05/23 REGS | 300,410    | 316,875    | 0.06     |
| USD                     | 250,000                    | DEVT BK OF MO 7.2500% 23/10/23 REGS | 247,433    | 271,250    | 0.05     |
|                         |                            | 合計：モンゴル                             | 547,843    | 588,125    | 0.11     |
|                         |                            |                                     | 547,843    | 588,125    | 0.11     |
| <b>モロッコ</b>             |                            |                                     |            |            |          |
| 普通社債(固定金利債)             |                            |                                     |            |            |          |
| USD                     | 400,000                    | OCP SA 5.1250% 23/06/51 REGS        | 392,964    | 403,640    | 0.07     |
| USD                     | 200,000                    | OCP SA 3.7500% 23/06/31 REGS        | 198,730    | 201,900    | 0.04     |
|                         |                            | 合計：モロッコ                             | 591,694    | 605,540    | 0.11     |
|                         |                            |                                     | 591,694    | 605,540    | 0.11     |
| <b>オランダ</b>             |                            |                                     |            |            |          |
| 転換社債                    |                            |                                     |            |            |          |
| EUR                     | 100,000                    | JUST EAT TAKE CV 0.6250% 09/02/28 B | 112,374    | 110,775    | 0.02     |
|                         |                            |                                     | 112,374    | 110,775    | 0.02     |
| <b>変動金利債</b>            |                            |                                     |            |            |          |
| EUR                     | 1,000,000                  | TELEFONICA EUROP FRN 31/12/70 .     | 1,206,343  | 1,280,056  | 0.25     |
| USD                     | 1,050,000                  | BRASKEM NL FRN 23/01/81 REGS        | 1,089,121  | 1,223,303  | 0.23     |
| EUR                     | 800,000                    | TELEFONICA EUROP FRN 31/03/70       | 979,913    | 1,061,103  | 0.20     |
| EUR                     | 300,000                    | TELEFONICA EUROP FRN 12/05/69       | 361,110    | 348,957    | 0.07     |
| EUR                     | 200,000                    | REPSOL INTL FIN 4.5% 25/03/75       | 208,811    | 259,899    | 0.05     |
| EUR                     | 200,000                    | COOPERATIEVE RAB FRN 29/12/69       | 219,840    | 246,053    | 0.05     |
| EUR                     | 200,000                    | WINTERSHALL FIN FRN 20/01/70 NC8    | 244,240    | 234,807    | 0.04     |
| USD                     | 200,000                    | ING GROEP NV FRN 16/11/69           | 200,000    | 221,520    | 0.04     |
| EUR                     | 100,000                    | VOLKSWAGEN INTFN FRN 17/06/70 .     | 117,294    | 128,476    | 0.02     |
|                         |                            |                                     | 4,626,672  | 5,004,174  | 0.95     |
| <b>その他債券</b>            |                            |                                     |            |            |          |
| USD                     | 300,000                    | MV24 CAPITAL 6.7480% 01/06/34 REGS  | 280,131    | 310,945    | 0.06     |
| USD                     | 200,000                    | MINEJESA CAPI 5.6250% 10/08/37 REGS | 208,200    | 216,500    | 0.04     |
| USD                     | 200,000                    | MINEJESA CAPI 4.6250% 10/08/30 REGS | 204,500    | 211,700    | 0.04     |
| EUR                     | 200,000                    | ZIGGO SEC 4.25% 15/01/27 REGS       | 200,259    | 197,218    | 0.04     |
|                         |                            |                                     | 893,090    | 936,363    | 0.18     |
| <b>ペイ・イン・カインド(PIK)債</b> |                            |                                     |            |            |          |
| EUR                     | 200,000                    | SUMMER BIDCO PIK 15/11/25 REGS      | 233,862    | 249,290    | 0.05     |
|                         |                            |                                     | 233,862    | 249,290    | 0.05     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b>      |                            |                                     |            |            |          |
| EUR                     | 1,084,000                  | SCHOELLER PAC 6.3750% 01/11/24 REGS | 1,196,900  | 1,339,640  | 0.24     |
| EUR                     | 942,000                    | ZIGGO 3.3750% 28/02/30 REGS         | 1,039,544  | 1,104,930  | 0.21     |
| USD                     | 900,000                    | PETROBRAS GLOB 5.6000% 03/01/31     | 921,688    | 1,008,000  | 0.19     |
| USD                     | 880,000                    | TEVA PHARMACEUTI 6.7500% 01/03/28   | 991,014    | 965,976    | 0.18     |
| EUR                     | 800,000                    | TEVA PHARM FNC NL 1.125% 15/10/24   | 805,089    | 892,576    | 0.17     |
| USD                     | 800,000                    | TEVA PHARMACEUTICALS 3.15% 01/10/26 | 663,240    | 762,392    | 0.14     |
| EUR                     | 582,000                    | SIGMA HOLDCO 5.7500% 15/05/26 REGS  | 700,565    | 671,859    | 0.13     |
| EUR                     | 550,000                    | INTERTRUST G 3.3750% 15/11/25 REGS  | 630,740    | 667,647    | 0.13     |
| EUR                     | 500,000                    | KB ACT SYS BV 5.0000% 15/07/25 REGS | 551,898    | 603,536    | 0.11     |
| USD                     | 485,000                    | PETROBRAS GBL FIN 6.85% 05/06/2115  | 458,080    | 554,404    | 0.11     |
| EUR                     | 480,000                    | FRIGOGLASS FI 6.8750% 12/02/25 REGS | 526,886    | 507,697    | 0.10     |
| USD                     | 457,000                    | PETROBRAS GLOB 5.0930% 15/01/30     | 747,932    | 499,273    | 0.09     |
| EUR                     | 378,000                    | TEVA PHARMACEUTICA 6.0000% 31/01/25 | 426,020    | 484,227    | 0.09     |
| EUR                     | 400,000                    | COMPACT BIDCO 5.7500% 01/05/26 REGS | 485,509    | 473,209    | 0.09     |
| USD                     | 400,000                    | METINVEST BV 8.5000% 23/04/26 REGS  | 354,532    | 455,224    | 0.09     |
| USD                     | 390,000                    | BRASKEM NL 5.8750% 31/01/50 REGS    | 385,527    | 427,541    | 0.08     |
| EUR                     | 360,000                    | UNITED GROUP 4.0000% 15/11/27 REGS  | 427,446    | 425,394    | 0.08     |
| USD                     | 400,000                    | ZIGGO BV 4.8750% 15/01/30 144A      | 413,750    | 410,000    | 0.08     |
| USD                     | 400,000                    | UPC BROAD FIN 4.8750% 15/07/31 144A | 400,000    | 400,000    | 0.08     |
| EUR                     | 300,000                    | ZF EUROPE 3.0000% 23/10/29          | 340,898    | 373,097    | 0.07     |
| EUR                     | 300,000                    | OI EUROPEAN GRP 3.125% 15/11/24 REG | 325,588    | 369,120    | 0.07     |
| EUR                     | 300,000                    | UPC HOLDING B 3.8750% 15/06/29 REGS | 327,782    | 361,886    | 0.07     |
| EUR                     | 300,000                    | TEVA PHARM FNC 1.8750% 31/03/27     | 260,959    | 327,004    | 0.06     |
| EUR                     | 260,000                    | MAXEDA DIY 5.8750% 01/10/26 REGS    | 311,119    | 317,162    | 0.06     |
| EUR                     | 270,000                    | VZ VENDOR 2.8750% 15/01/29 REGS     | 327,604    | 314,692    | 0.06     |
| USD                     | 285,000                    | IHS NETHERLAN 8.0000% 18/09/27 REGS | 285,000    | 308,513    | 0.06     |
| EUR                     | 245,000                    | ENERGIZER G 3.5000% 30/06/29 REGS   | 298,326    | 290,554    | 0.06     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨                 | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価       | 評価金額       | 純資産比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------|------------|----------|
| EUR                | 210,000                    | NOBEL BIDCO B 3.1250% 15/06/28 REGS | 255,980    | 249,921    | 0.05     |
| EUR                | 200,000                    | UNITED GROUP 3.1250% 15/02/26 REGS  | 221,670    | 231,475    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | EMBRAER NL FI 6.9500% 17/01/28 REGS | 224,500    | 228,670    | 0.04     |
| EUR                | 190,000                    | NOBIAN FINANC 3.6250% 15/07/26 REGS | 226,556    | 225,350    | 0.04     |
| EUR                | 170,000                    | DIEBOLD NIXDO 9.0000% 15/07/25 REGS | 192,243    | 222,053    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | METINVEST BV 7.7500% 17/10/29 REGS  | 162,000    | 221,652    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | TRIVIUM PACK 8.5000% 15/08/27 144A  | 216,000    | 217,504    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | METINVEST BV 7.7500% 23/04/23 REGS  | 188,980    | 213,712    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | LUKOIL SECURI 3.8750% 06/05/30 REGS | 210,200    | 211,432    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | VEON HOLDINGS 4.0000% 09/04/25 REGS | 209,960    | 210,500    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | CLEAR CHANNEL 6.6250% 01/08/25 144A | 208,500    | 210,166    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | IHS NETHERLAN 7.1250% 18/03/25 REGS | 200,000    | 208,500    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | SENSATA TECH 4.0000% 15/04/29 144A  | 200,000    | 202,836    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | EQUATE PETROC 2.6250% 28/04/28 REGS | 199,796    | 202,000    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | VEON HOLDINGS 3.3750% 25/11/27 REGS | 201,200    | 200,500    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | PROSUS NV 4.0270% 03/08/50 REGS     | 200,000    | 192,717    | 0.04     |
| USD                | 150,000                    | ZIGGO 6.0000% 15/01/27 144A         | 151,500    | 156,750    | 0.03     |
| EUR                | 120,000                    | IPD 3 BV 5.5000% 01/12/25 REGS      | 142,146    | 148,482    | 0.03     |
| USD                | 150,000                    | EAGLE INT/RUY 7.5000% 01/05/25 144A | 141,938    | 144,750    | 0.03     |
| EUR                | 125,000                    | DUFREY ONE BV 2.0000% 15/02/27      | 142,131    | 140,218    | 0.03     |
| EUR                | 100,000                    | NE PROPERTY 1.8750% 09/10/26 EMTN   | 111,735    | 122,215    | 0.02     |
| USD                | 100,000                    | PETROBRAS GLOB 5.5000% 10/06/51     | 96,446     | 100,533    | 0.02     |
| 合計：オランダ            |                            |                                     | 18,717,117 | 19,577,489 | 3.71     |
|                    |                            |                                     | 24,583,115 | 25,878,091 | 4.91     |
| <b>ナイジェリア</b>      |                            |                                     |            |            |          |
| 国債                 |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 300,000                    | REP OF NIGERI 9.2480% 21/01/49 REGS | 334,670    | 342,012    | 0.07     |
| USD                | 200,000                    | REP OF NIGERI 8.7470% 21/01/31 REGS | 224,500    | 227,002    | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 559,170    | 569,014    | 0.11     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 275,000                    | SEPLAT ENERGY 7.7500% 01/04/26 REGS | 275,000    | 286,759    | 0.05     |
| USD                | 200,000                    | AFRICA FINANC 2.8750% 28/04/28 REGS | 198,544    | 200,604    | 0.04     |
| 合計：ナイジェリア          |                            |                                     | 473,544    | 487,363    | 0.09     |
|                    |                            |                                     | 1,032,714  | 1,056,377  | 0.20     |
| <b>ノルウェー</b>       |                            |                                     |            |            |          |
| 普通社債(固定金利債)        |                            |                                     |            |            |          |
| EUR                | 384,000                    | ADEVINTA ASA 3.0000% 15/11/27 REGS  | 477,846    | 472,473    | 0.09     |
| EUR                | 250,000                    | ADEVINTA ASA 2.6250% 15/11/25 REGS  | 307,347    | 305,261    | 0.06     |
| 合計：ノルウェー           |                            |                                     | 785,193    | 777,734    | 0.15     |
|                    |                            |                                     | 785,193    | 777,734    | 0.15     |
| <b>オマーン</b>        |                            |                                     |            |            |          |
| 国債                 |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 600,000                    | OMAN INTRNL B 6.7500% 17/01/48 REGS | 566,750    | 596,232    | 0.11     |
| USD                | 200,000                    | OMAN GVT INTL 6.5% 08/03/47 REGS    | 200,985    | 195,246    | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 767,735    | 791,478    | 0.15     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 560,000                    | BANKMUSCAT 4.7500% 17/03/26 EMTN    | 566,370    | 581,000    | 0.11     |
| USD                | 250,000                    | NATL BANK OMA 5.6250% 25/09/23 EMTN | 261,500    | 262,561    | 0.05     |
| 合計：オマーン            |                            |                                     | 827,870    | 843,561    | 0.16     |
|                    |                            |                                     | 1,595,605  | 1,635,039  | 0.31     |
| <b>パキスタン</b>       |                            |                                     |            |            |          |
| 国債                 |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 400,000                    | REP OF PAKIST 6.8750% 05/12/27 REGS | 412,550    | 415,496    | 0.08     |
| USD                | 224,000                    | ISLAMIC REP PAKIST 8.25% 15/4/24 R  | 242,765    | 244,922    | 0.05     |
|                    |                            |                                     | 655,315    | 660,418    | 0.13     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 400,000                    | REP OF PAKIST 7.3750% 08/04/31 REGS | 400,000    | 411,500    | 0.07     |
| USD                | 400,000                    | PAKISTAN WATER 7.5000% 04/06/31     | 400,000    | 400,000    | 0.08     |
| 合計：パキスタン           |                            |                                     | 800,000    | 811,500    | 0.15     |
|                    |                            |                                     | 1,455,315  | 1,471,918  | 0.28     |
| <b>パナマ</b>         |                            |                                     |            |            |          |
| 変動金利債              |                            |                                     |            |            |          |
| USD                | 200,000                    | GLOBAL BANK CORP FRN 16/04/29 REGS  | 205,282    | 209,500    | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | BANCO GENERAL FRN 07/11/69 REGS     | 200,000    | 209,322    | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 405,282    | 418,822    | 0.08     |

| 通貨                 | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価      | 評価金額      | 純資産比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|----------|
| <b>国債</b>          |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 400,000                    | PANAMA 4.5000% 01/04/56             | 410,396   | 451,500   | 0.09     |
|                    |                            |                                     | 410,396   | 451,500   | 0.09     |
| <b>その他債券</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 700,000                    | AES PANAMA GE 4.3750% 31/05/30 REGS | 716,966   | 731,608   | 0.14     |
| USD                | 200,000                    | PANAMA 4.5000% 15/05/47             | 223,520   | 226,500   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | AEROPUERTO IN 6.0000% 18/11/48 REGS | 191,731   | 213,768   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | UEP PENNONOME 6.5000% 01/10/38 REGS | 197,194   | 201,140   | 0.04     |
| USD                | 15,000                     | REP OF PANAMA 6.7% 26/01/36         | 19,249    | 20,363    | 0.00     |
|                    |                            |                                     | 1,348,660 | 1,393,379 | 0.26     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 1,085,000                  | CARNIVAL CORP 5.7500% 01/03/27 144A | 1,092,908 | 1,145,619 | 0.22     |
| EUR                | 400,000                    | CARNIVAL COR 10.1250% 01/02/26 REGS | 512,116   | 555,182   | 0.11     |
| USD                | 300,000                    | CARNIVAL COR 10.5000% 01/02/26 144A | 328,875   | 349,275   | 0.07     |
| USD                | 255,000                    | CABLE ONDA SA 4.5000% 30/01/30 REGS | 260,738   | 268,311   | 0.05     |
| EUR                | 200,000                    | CARNIVAL CORP 1.8750% 07/11/22      | 201,166   | 235,616   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | MULTIBANK INC 4.3750% 09/11/22 REGS | 199,912   | 204,752   | 0.04     |
| USD                | 150,000                    | CARNIVAL CORP 9.8750% 01/08/27 144A | 150,000   | 174,750   | 0.03     |
| USD                | 150,000                    | CARNIVAL CORP 7.6250% 01/03/26 144A | 150,000   | 163,605   | 0.03     |
|                    |                            |                                     | 2,895,715 | 3,097,110 | 0.59     |
|                    |                            | 合計：パナマ                              | 5,060,053 | 5,360,811 | 1.02     |
| <b>バラグアイ</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 320,000                    | REPUBLIC OF P 5.6000% 13/03/48 REGS | 320,000   | 376,400   | 0.07     |
|                    |                            |                                     | 320,000   | 376,400   | 0.07     |
|                    |                            | 合計：バラグアイ                            | 320,000   | 376,400   | 0.07     |
| <b>ペルー</b>         |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 100,000                    | REPUBLIC OF PERU 8.7500% 21/11/33   | 152,635   | 156,274   | 0.03     |
| USD                | 85,000                     | REPUBLIC OF PERU 2.7800% 01/12/60   | 84,027    | 75,861    | 0.01     |
| USD                | 35,000                     | REPUBLIC OF PERU 3.2300% 28/07/2121 | 34,505    | 31,054    | 0.01     |
|                    |                            |                                     | 271,167   | 263,189   | 0.05     |
| <b>その他債券</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 200,000                    | FENIX POWER P 4.3170% 20/09/27 REGS | 172,353   | 174,940   | 0.03     |
|                    |                            |                                     | 172,353   | 174,940   | 0.03     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 240,000                    | INRETAIL SHOP 5.7500% 03/04/28 REGS | 234,179   | 247,799   | 0.05     |
| USD                | 230,000                    | INRETAIL CONS 3.2500% 22/03/28 REGS | 230,000   | 227,040   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | VOLCAN CIA MI 4.3750% 11/02/26 REGS | 200,000   | 198,000   | 0.04     |
| USD                | 40,000                     | BANCO INTER P 3.2500% 04/10/26 REGS | 42,296    | 40,876    | 0.01     |
|                    |                            |                                     | 706,475   | 713,715   | 0.14     |
|                    |                            | 合計：ペルー                              | 1,149,995 | 1,151,844 | 0.22     |
| <b>フィリピン</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 370,000                    | REP OF PHILIPPINES 5.5% 30/03/26    | 453,250   | 447,529   | 0.09     |
| USD                | 350,000                    | REP OF PHILIPPINES 3.95% 20/01/40   | 362,075   | 388,739   | 0.07     |
| USD                | 350,000                    | PHILIPPINES(REP) 2.9500% 05/05/45   | 350,000   | 337,690   | 0.06     |
|                    |                            |                                     | 1,165,325 | 1,173,958 | 0.22     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 350,000                    | NATIONAL POWER 9.625% 15/05/28      | 437,636   | 513,625   | 0.10     |
|                    |                            |                                     | 437,636   | 513,625   | 0.10     |
|                    |                            | 合計：フィリピン                            | 1,602,961 | 1,687,583 | 0.32     |
| <b>ポルトガル</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| 変動金利債              |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                | 400,000                    | EDP SA FRN 30/04/79                 | 454,620   | 518,289   | 0.10     |
| EUR                | 200,000                    | BANCO COM PORTUG FRN 30/04/70       | 242,983   | 250,429   | 0.05     |
|                    |                            |                                     | 697,603   | 768,718   | 0.15     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                | 100,000                    | CAIXA GERAL D 1.2500% 25/11/24 EMTN | 110,467   | 122,723   | 0.02     |
|                    |                            |                                     | 110,467   | 122,723   | 0.02     |
|                    |                            | 合計：ポルトガル                            | 808,070   | 891,441   | 0.17     |

| 通貨                 | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価      | 評価金額      | 純資産比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|----------|
| <b>カタール</b>        |                            |                                     |           |           |          |
| <b>国債</b>          |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 700,000                    | QATAR STATE O 4.8170% 14/03/49 REGS | 760,617   | 901,258   | 0.18     |
| USD                | 600,000                    | QATAR STATE O 4.4000% 16/04/50 REGS | 638,960   | 730,555   | 0.14     |
| USD                | 200,000                    | QATAR STATE O 5.1030% 23/04/48 REGS | 205,429   | 265,238   | 0.05     |
| USD                | 200,000                    | QATAR STATE O 4.0000% 14/03/29 REGS | 199,298   | 230,216   | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 1,804,304 | 2,127,267 | 0.41     |
| <b>その他債券</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 17,000                     | RAS LAFFAN LNG 6.332% 30/09/27 REGS | 18,060    | 19,532    | 0.00     |
|                    |                            |                                     | 18,060    | 19,532    | 0.00     |
|                    |                            | 合計：カタール                             | 1,822,364 | 2,146,799 | 0.41     |
| <b>韓国</b>          |                            |                                     |           |           |          |
| <b>変動金利債</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 500,000                    | WOORI BANK FRN 29/12/49 REGS        | 500,000   | 504,005   | 0.09     |
| USD                | 250,000                    | SHINHAN FINL GRP FRN 12/11/69 REGS  | 250,000   | 248,470   | 0.05     |
| USD                | 200,000                    | SHINHAN FINL GRP FRN 05/02/30 REGS  | 209,358   | 209,218   | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 959,358   | 961,693   | 0.18     |
|                    |                            | 合計：韓国                               | 959,358   | 961,693   | 0.18     |
| <b>ルーマニア</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| <b>国債</b>          |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 280,000                    | ROMANIA 4.0000% 14/02/51 REGS       | 280,152   | 294,145   | 0.05     |
| USD                | 280,000                    | ROMANIA 3.0000% 14/02/31 REGS       | 278,860   | 289,883   | 0.05     |
| USD                | 30,000                     | ROMANIA GVT 6.125% 22/01/44 REGS    | 39,900    | 40,965    | 0.01     |
|                    |                            |                                     | 598,912   | 624,993   | 0.11     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                | 200,000                    | RCS & RDS SA 3.2500% 05/02/28 REGS  | 220,240   | 238,148   | 0.05     |
|                    |                            |                                     | 220,240   | 238,148   | 0.05     |
|                    |                            | 合計：ルーマニア                            | 819,152   | 863,141   | 0.16     |
| <b>ロシア</b>         |                            |                                     |           |           |          |
| <b>国債</b>          |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 2,000,000                  | RUSSIA-EUROBO 4.3750% 21/03/29 REGS | 2,059,022 | 2,254,480 | 0.42     |
| USD                | 200,000                    | RUSSIA-EUROBO 5.2500% 23/06/47 REGS | 236,700   | 251,250   | 0.05     |
| USD                | 200,000                    | RUSSIA-EUROBO 4.8750% 16/09/23 REGS | 218,600   | 217,004   | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 2,514,322 | 2,722,734 | 0.51     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 200,000                    | OAO TMK 4.3000% 12/02/27            | 200,000   | 200,946   | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 200,000   | 200,946   | 0.04     |
|                    |                            | 合計：ロシア                              | 2,714,322 | 2,923,680 | 0.55     |
| <b>サウジアラビア</b>     |                            |                                     |           |           |          |
| <b>国債</b>          |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 350,000                    | SAUDI INT BON 5.0000% 17/04/49 REGS | 390,860   | 441,721   | 0.08     |
| USD                | 200,000                    | SAUDI INT BON 5.2500% 16/01/50 REGS | 207,194   | 261,764   | 0.05     |
| USD                | 200,000                    | SAUDI INT BON 4.6250% 04/10/47 REGS | 225,700   | 238,708   | 0.05     |
|                    |                            |                                     | 823,754   | 942,193   | 0.18     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 815,000                    | SAUDI INT BON 3.4500% 02/02/61 REGS | 814,999   | 813,663   | 0.15     |
| USD                | 650,000                    | SAUDI INT BON 4.5000% 22/04/60 REGS | 645,277   | 786,221   | 0.15     |
| USD                | 400,000                    | SAUDI INT BON 3.2500% 22/10/30 REGS | 424,440   | 430,500   | 0.08     |
| USD                | 200,000                    | SAUDI ARAB OI 4.2500% 16/04/39 REGS | 219,622   | 223,844   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | SAUDI ARAB OI 1.6250% 24/11/25 REGS | 199,934   | 201,900   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | SAUDI ARAB OI 3.5000% 24/11/70 REGS | 197,668   | 194,000   | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 2,501,940 | 2,650,128 | 0.50     |
|                    |                            | 合計：サウジアラビア                          | 3,325,694 | 3,592,321 | 0.68     |
| <b>シンガポール</b>      |                            |                                     |           |           |          |
| <b>変動金利債</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                | 400,000                    | TRAFIGURA GROUP FRN 31/01/70 1      | 518,267   | 515,313   | 0.09     |
| USD                | 200,000                    | UNITED OVERSEAS FRN 15/04/29 REGS   | 199,314   | 212,794   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | UNITED OVERSEAS FRN 19/04/70 EMTN   | 207,450   | 206,750   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | DBS GROUP HLDGS FRN 27/08/69 GMTN   | 200,078   | 205,816   | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 1,125,109 | 1,140,673 | 0.21     |
| <b>その他債券</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 300,000                    | LLPL CAPITAL 6.8750% 04/02/39 REGS  | 273,600   | 317,513   | 0.06     |
|                    |                            |                                     | 273,600   | 317,513   | 0.06     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨                 | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価      | 評価金額      | 純資産比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|----------|
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 290,000                    | MEDCO BELL 6.3750% 30/01/27 REGS    | 285,992   | 298,845   | 0.06     |
| USD                | 200,000                    | ABJA INVESTMENT 5.4500% 24/01/28    | 200,000   | 214,830   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | GLP PTE LTD 3.8750% 04/06/25 EMTN   | 208,234   | 211,468   | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 694,226   | 725,143   | 0.14     |
|                    |                            | 合計：シンガポール                           | 2,092,935 | 2,183,329 | 0.41     |
| <b>南アフリカ</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| <b>国債</b>          |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 425,000                    | SOUTH AFRICA 5.7500% 30/09/49       | 425,000   | 434,133   | 0.08     |
| USD                | 295,000                    | REP OF SOUTH AFRICA 4.3% 12/10/28   | 288,593   | 304,666   | 0.06     |
| USD                | 200,000                    | SOUTH AFRICA 5.8750% 22/06/30       | 221,220   | 228,164   | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 934,813   | 966,963   | 0.18     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 445,000                    | ESKOM HLDG 7.125% 11/02/25 REGS     | 449,666   | 469,475   | 0.09     |
|                    |                            |                                     | 449,666   | 469,475   | 0.09     |
|                    |                            | 合計：南アフリカ                            | 1,384,479 | 1,436,438 | 0.27     |
| <b>スペイン</b>        |                            |                                     |           |           |          |
| <b>転換社債</b>        |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                | 600,000                    | CELLNEX TE CV 0.7500% 20/11/31 CLNX | 688,840   | 697,637   | 0.13     |
| EUR                | 400,000                    | INTL CONSOL CV 0.6250% 17/11/22 IAG | 463,511   | 459,141   | 0.09     |
|                    |                            |                                     | 1,152,351 | 1,156,778 | 0.22     |
| <b>変動金利債</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                | 600,000                    | BANCO SANTANDER FRN 29/12/69        | 654,988   | 755,746   | 0.14     |
| EUR                | 600,000                    | BANCO DE SABADELL FRN 29/12/49      | 694,007   | 733,162   | 0.14     |
| EUR                | 400,000                    | BANKINTER SA FRN 17/10/69           | 451,040   | 539,116   | 0.10     |
| EUR                | 400,000                    | BANCO CRED SOC C FRN 27/11/31 EMTN  | 489,742   | 489,665   | 0.09     |
| EUR                | 200,000                    | BANKINTER SA FRN 23/12/32           | 242,018   | 238,506   | 0.05     |
|                    |                            |                                     | 2,531,795 | 2,756,195 | 0.52     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                | 600,000                    | GRIFOLS SA 3.2% 01/05/25 REGS       | 702,322   | 720,059   | 0.15     |
| EUR                | 410,000                    | LORCA TELECOM 4.0000% 18/09/27 REGS | 480,754   | 496,480   | 0.09     |
| EUR                | 400,000                    | INTL CONSOLIDAT 3.7500% 25/03/29    | 480,275   | 477,230   | 0.09     |
| EUR                | 300,000                    | CELLNEX FINAN 1.5000% 08/06/28 EMTN | 366,848   | 357,374   | 0.07     |
| EUR                | 300,000                    | TENDAM BRANDS 5.0000% 15/09/24 REGS | 315,807   | 350,697   | 0.07     |
| EUR                | 200,000                    | BANCO SABADEL 5.6250% 06/05/26 EMTN | 237,105   | 277,293   | 0.05     |
| EUR                | 200,000                    | CELLNEX TELEC 2.8750% 18/04/25 EMTN | 245,340   | 257,293   | 0.05     |
| EUR                | 190,000                    | NEINOR HOMES 4.5000% 15/10/26 REGS  | 227,515   | 231,483   | 0.04     |
| EUR                | 150,000                    | GRIFOLS SA 2.2500% 15/11/27 REGS    | 165,758   | 181,634   | 0.03     |
| EUR                | 125,000                    | NH HOTEL GRP 4.0000% 02/07/26 REGS  | 149,931   | 148,583   | 0.03     |
| EUR                | 100,000                    | VIA CEL DES I 5.2500% 01/04/26 REGS | 119,650   | 123,770   | 0.02     |
| EUR                | 100,000                    | GRUPO-ANTOLIN 3.3750% 30/04/26 REGS | 107,732   | 119,605   | 0.02     |
|                    |                            |                                     | 3,599,037 | 3,741,501 | 0.71     |
|                    |                            | 合計：スペイン                             | 7,283,183 | 7,654,474 | 1.45     |
| <b>スリランカ</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| <b>国債</b>          |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 350,000                    | REP OF SRI LA 7.5500% 28/03/30 REGS | 349,825   | 222,252   | 0.04     |
| USD                | 300,000                    | REP OF SRI LA 6.7500% 18/04/28 REGS | 292,426   | 189,747   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | REP OF SRI LA 7.8500% 14/03/29 REGS | 200,000   | 127,002   | 0.02     |
|                    |                            |                                     | 842,251   | 539,001   | 0.10     |
|                    |                            | 合計：スリランカ                            | 842,251   | 539,001   | 0.10     |
| <b>スウェーデン</b>      |                            |                                     |           |           |          |
| <b>変動金利債</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                | 500,000                    | SAMHALLSBYGG FRN 26/07/69           | 565,584   | 634,990   | 0.13     |
| EUR                | 440,000                    | ASSEMBLIN FIN FRN 15/05/25 REGS     | 484,462   | 529,797   | 0.10     |
| EUR                | 420,000                    | SAMHALLSBYGG FRN 30/01/70           | 497,391   | 495,469   | 0.09     |
| USD                | 400,000                    | SKANDINAV ENSKIL FRN 13/05/70       | 400,000   | 424,500   | 0.08     |
| EUR                | 300,000                    | HEIMSTADEN BOSTA FRN 19/02/70       | 330,975   | 369,526   | 0.07     |
| EUR                | 100,000                    | VERISURE HOLDING FRN 15/04/25 REGS  | 108,107   | 121,206   | 0.02     |
|                    |                            |                                     | 2,386,519 | 2,575,488 | 0.49     |
| <b>その他債券</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                | 300,000                    | INTRUM AB 2.7500% 15/07/22 REGS     | 33,163    | 35,700    | 0.01     |
|                    |                            |                                     | 33,163    | 35,700    | 0.01     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                | 940,000                    | INTRUM AB 3.0000% 15/09/27 REGS     | 1,038,325 | 1,104,712 | 0.20     |
| EUR                | 488,000                    | VERISURE HOLD 3.2500% 15/02/27 REGS | 593,682   | 580,874   | 0.11     |

| 通貨                 | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価      | 評価金額      | 純資産比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|----------|
| EUR                | 453,000                    | VERISURE MIDH 5.2500% 15/02/29 REGS | 550,010   | 553,941   | 0.11     |
| EUR                | 425,000                    | INTRUM AB 3.5000% 15/07/26 REGS     | 473,259   | 515,302   | 0.10     |
| EUR                | 300,000                    | INTRUM AB 4.8750% 15/08/25 REGS     | 347,955   | 374,917   | 0.07     |
| EUR                | 272,000                    | VERISURE HOLD 3.8750% 15/07/26 REGS | 309,101   | 330,774   | 0.06     |
| EUR                | 240,000                    | UNILABS SUB 5.75% 15/05/25 REGS     | 286,171   | 290,094   | 0.05     |
| EUR                | 200,000                    | POLYGON AB 4.0000% 23/02/23         | 224,518   | 239,924   | 0.05     |
|                    |                            | 合計：スウェーデン                           | 3,823,021 | 3,990,538 | 0.75     |
|                    |                            |                                     | 6,242,703 | 6,601,726 | 1.25     |
| <b>タイ</b>          |                            |                                     |           |           |          |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 250,000                    | GC TREASURY 2.9800% 18/03/31 REGS   | 246,695   | 255,375   | 0.04     |
| USD                | 100,000                    | BANGKOK BANK/ 9.0250% 15/03/29 REGS | 128,990   | 140,181   | 0.03     |
|                    |                            | 合計：タイ                               | 375,685   | 395,556   | 0.07     |
|                    |                            |                                     | 375,685   | 395,556   | 0.07     |
| <b>トーゴ</b>         |                            |                                     |           |           |          |
| <b>変動金利債</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 350,000                    | ECOBANK TRANS FRN 17/06/31 REGS     | 347,228   | 356,825   | 0.07     |
|                    |                            | 合計：トーゴ                              | 347,228   | 356,825   | 0.07     |
|                    |                            |                                     | 347,228   | 356,825   | 0.07     |
| <b>トリニダード・トバゴ</b>  |                            |                                     |           |           |          |
| <b>国債</b>          |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 200,000                    | TRINIDAD&TOBA 4.5000% 26/06/30 REGS | 200,000   | 208,500   | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 200,000   | 208,500   | 0.04     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 200,000                    | TRINIDAD PETR 9.7500% 15/06/26 REGS | 224,693   | 222,971   | 0.04     |
|                    |                            | 合計：トリニダード・トバゴ                       | 224,693   | 222,971   | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 424,693   | 431,471   | 0.08     |
| <b>トルコ</b>         |                            |                                     |           |           |          |
| <b>国債</b>          |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 900,000                    | TURKEY REP OF 5.8750% 26/06/31      | 899,881   | 872,993   | 0.17     |
| USD                | 780,000                    | TURKEY REP OF 5.2500% 13/03/30      | 756,475   | 739,164   | 0.14     |
| USD                | 500,000                    | TURKEY REP OF 7.6250% 26/04/29      | 534,950   | 547,337   | 0.10     |
| USD                | 485,000                    | TURKEY REP OF 4.7500% 26/01/26      | 482,375   | 477,119   | 0.09     |
| USD                | 350,000                    | REP OF TURKEY 4.875% 16/04/43       | 322,585   | 278,189   | 0.05     |
| USD                | 200,000                    | TURKEY REP OF 6.0000% 25/03/27      | 199,200   | 204,248   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | TURKEY REP OF 6.1250% 24/10/28      | 198,854   | 203,154   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | ISTANBUL METR 6.3750% 09/12/25 REGS | 200,250   | 199,251   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | TURKEY REP OF 5.7500% 11/05/47      | 156,000   | 170,673   | 0.03     |
| EUR                | 100,000                    | TURKEY REP OF 5.2000% 16/02/26      | 129,513   | 124,695   | 0.02     |
| USD                | 41,000                     | TURKEY REP OF 6.8750% 17/03/36      | 50,082    | 41,308    | 0.01     |
|                    |                            | 合計：トルコ                              | 3,930,165 | 3,858,131 | 0.73     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 300,000                    | IS BANKASI 6.1250% 25/04/24 REGS    | 306,051   | 312,000   | 0.06     |
| USD                | 300,000                    | VAKIFBANK 6.5000% 08/01/26 REGS     | 298,374   | 306,750   | 0.06     |
| USD                | 250,000                    | AKBANK 6.8000% 06/02/26 REGS        | 249,975   | 263,495   | 0.05     |
| USD                | 200,000                    | SISECAM 6.9500% 14/03/26 REGS       | 196,752   | 222,000   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | TURK TELEKOM 6.8750% 28/02/25 REGS  | 211,800   | 220,632   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | YAPI KREDI BA 8.2500% 15/10/24 REGS | 199,968   | 218,173   | 0.04     |
| USD                | 200,000                    | TC ZIRAAT BAN 5.3750% 02/03/26 REGS | 198,890   | 196,500   | 0.04     |
|                    |                            | 合計：トルコ                              | 1,661,810 | 1,739,550 | 0.33     |
|                    |                            |                                     | 5,591,975 | 5,597,681 | 1.06     |
| <b>ウクライナ</b>       |                            |                                     |           |           |          |
| <b>国債</b>          |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 650,000                    | UKRAINE GOVT 7.2530% 15/03/33 REGS  | 683,615   | 676,818   | 0.13     |
| EUR                | 400,000                    | UKRAINE GOVT 4.3750% 27/01/30 REGS  | 443,340   | 444,075   | 0.08     |
| USD                | 400,000                    | UKRAINE GOVT 7.3750% 25/09/32 REGS  | 368,103   | 419,408   | 0.08     |
| USD                | 400,000                    | UKRAINE GOVT 6.8760% 21/05/29 REGS  | 400,000   | 414,500   | 0.08     |
| USD                | 130,000                    | UKRAINE GVT 7.75% 01/09/25 REGS     | 117,724   | 142,325   | 0.03     |
| USD                | 100,000                    | UKRAINE GVT 7.75% 01/09/26 REGS     | 93,250    | 110,371   | 0.02     |
| USD                | 100,000                    | UKRAINE GVT 7.75% 01/09/23 REGS     | 107,875   | 107,749   | 0.02     |
|                    |                            | 合計：ウクライナ                            | 2,213,907 | 2,315,246 | 0.44     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |           |           |          |
| USD                | 200,000                    | VF UKRAINE 6.2000% 11/02/25 REGS    | 200,000   | 208,500   | 0.04     |
|                    |                            | 合計：ウクライナ                            | 200,000   | 208,500   | 0.04     |
|                    |                            |                                     | 2,413,907 | 2,523,746 | 0.48     |

| 通貨                      | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価      | 評価金額      | 純資産比率(%) |
|-------------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|----------|
| <b>アラブ首長国連邦</b>         |                            |                                     |           |           |          |
| <b>変動金利債</b>            |                            |                                     |           |           |          |
| USD                     | 595,000                    | NBK TIER 1 FNC FRN 24/08/69 REGS    | 595,000   | 597,029   | 0.11     |
| USD                     | 200,000                    | EMIRATES NBD FRN 20/09/69           | 211,460   | 215,500   | 0.04     |
| USD                     | 200,000                    | NBK TIER 1 FIN FRN 27/05/70 REGS    | 209,700   | 208,766   | 0.04     |
| USD                     | 200,000                    | NBK TIER 2 FRN 24/11/30             | 203,800   | 201,000   | 0.04     |
|                         |                            |                                     | 1,219,960 | 1,222,295 | 0.23     |
| <b>国債</b>               |                            |                                     |           |           |          |
| USD                     | 600,000                    | ABU DHABI GOV 3.1250% 30/09/49 REGS | 635,040   | 612,242   | 0.12     |
|                         |                            |                                     | 635,040   | 612,242   | 0.12     |
| <b>その他債券</b>            |                            |                                     |           |           |          |
| USD                     | 390,000                    | ACWA POW MGMT INV 5.95% 15/12/39 RE | 404,611   | 462,653   | 0.09     |
|                         |                            |                                     | 404,611   | 462,653   | 0.09     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b>      |                            |                                     |           |           |          |
| USD                     | 610,000                    | DUBAI GOVT IN 3.9000% 09/09/50 EMTN | 599,398   | 570,349   | 0.10     |
| USD                     | 500,000                    | OZTEL HLDG SP 5.6250% 24/10/23 REGS | 495,397   | 531,690   | 0.10     |
| USD                     | 500,000                    | FIN DEPT SHAR 4.3750% 10/03/51 REGS | 469,500   | 481,900   | 0.09     |
| USD                     | 300,000                    | TAQA ABU DHAB 4.8750% 23/04/30 REGS | 299,865   | 361,824   | 0.07     |
| USD                     | 330,000                    | KUWAIT PROJECTS 4.2290% 29/10/26    | 330,000   | 326,700   | 0.06     |
| USD                     | 200,000                    | DP WORLD PLC 5.6250% 25/09/48 REGS  | 197,856   | 249,742   | 0.05     |
| USD                     | 200,000                    | ABU DHABI GOV 3.8750% 16/04/50 REGS | 245,600   | 230,250   | 0.04     |
| USD                     | 200,000                    | NATIONAL CENTRAL 2.5000% 21/10/27   | 197,728   | 198,517   | 0.04     |
| USD                     | 100,000                    | TAQA ABU DHAB 6.5000% 27/10/36 REGS | 147,980   | 144,330   | 0.03     |
|                         |                            |                                     | 2,983,324 | 3,095,302 | 0.58     |
|                         |                            | 合計：アラブ首長国連邦                         | 5,242,935 | 5,392,492 | 1.02     |
| <b>イギリス</b>             |                            |                                     |           |           |          |
| <b>転換社債</b>             |                            |                                     |           |           |          |
| GBP                     | 100,000                    | WH SMITH CV 1.6250% 07/05/26        | 142,864   | 135,474   | 0.03     |
|                         |                            |                                     | 142,864   | 135,474   | 0.03     |
| <b>変動金利債</b>            |                            |                                     |           |           |          |
| GBP                     | 400,000                    | VODAFONE GROUP FRN 03/10/78         | 559,819   | 601,294   | 0.12     |
| USD                     | 500,000                    | VODAFONE GROUP FRN 03/10/78         | 541,875   | 552,225   | 0.11     |
| GBP                     | 200,000                    | NATWEST GROUP FRN 31/03/70          | 276,920   | 283,900   | 0.05     |
| USD                     | 240,000                    | STANDARD CHART FRN 26/01/70 REGS    | 239,981   | 263,196   | 0.05     |
| USD                     | 250,000                    | GAZPROM PJSC FRN 26/01/70 REGS      | 250,000   | 260,529   | 0.05     |
| USD                     | 200,000                    | BARCLAYS PLC FRN 15/09/69           | 212,000   | 227,500   | 0.04     |
| USD                     | 200,000                    | UKREXIMBANK(BIZ FI 9.9500% 14/11/29 | 200,000   | 201,750   | 0.04     |
| USD                     | 150,000                    | VODAFONE GROUP FRN 04/04/79         | 174,510   | 182,851   | 0.03     |
| GBP                     | 100,000                    | CO-OPERATIVE FIN FRN 27/11/25       | 132,715   | 154,611   | 0.03     |
| EUR                     | 100,000                    | STONEGATE PUB FRN 31/07/25 REGS     | 107,866   | 117,820   | 0.02     |
|                         |                            |                                     | 2,695,686 | 2,845,676 | 0.54     |
| <b>その他債券</b>            |                            |                                     |           |           |          |
| GBP                     | 1,180,000                  | JOHNSTON PRES 8.6250% 01/06/19 REGS | 417,444   | 0         | 0.00     |
|                         |                            |                                     | 417,444   | 0         | 0.00     |
| <b>ペイ・イン・カインド(PIK)債</b> |                            |                                     |           |           |          |
| GBP                     | 100,000                    | BRACKEN MIDCO PIK 15/10/23 REGS     | 140,594   | 142,858   | 0.03     |
|                         |                            |                                     | 140,594   | 142,858   | 0.03     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b>      |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                     | 784,000                    | JAGUAR LAND R 5.8750% 15/11/24 REGS | 956,319   | 1,024,924 | 0.18     |
| GBP                     | 655,000                    | BELLIS ACQUIS 3.2500% 16/02/26 REGS | 912,155   | 907,095   | 0.16     |
| GBP                     | 500,000                    | HURRICANE FNC 8.0000% 15/10/25 REGS | 680,856   | 752,779   | 0.13     |
| USD                     | 900,000                    | VEDANTA RESOU 6.1250% 09/08/24 REGS | 734,750   | 751,949   | 0.13     |
| GBP                     | 514,000                    | JERROLD FINCO 4.8750% 15/01/26 REGS | 678,458   | 730,789   | 0.13     |
| GBP                     | 500,000                    | SHOP DIRECT 7.7500% 15/11/22 REGS   | 601,883   | 695,575   | 0.12     |
| EUR                     | 518,000                    | ROLLS-ROYCE P 4.6250% 16/02/26 REGS | 611,357   | 672,263   | 0.13     |
| USD                     | 610,000                    | JAGUAR LAND R 7.7500% 15/10/25 144A | 628,500   | 669,475   | 0.13     |
| GBP                     | 484,000                    | VIRGIN MEDIA 4.1250% 15/08/30 REGS  | 608,121   | 662,858   | 0.13     |
| USD                     | 600,000                    | LIQUID TELECO 5.5000% 04/09/26 REGS | 600,000   | 614,370   | 0.12     |
| EUR                     | 500,000                    | MODULAIRE GLO 6.5000% 15/02/23 REGS | 578,422   | 607,285   | 0.12     |
| GBP                     | 413,000                    | PUNCH FINANCE 6.1250% 30/06/26 REGS | 577,386   | 578,422   | 0.11     |
| EUR                     | 420,000                    | INTL GAME TEC 3.5000% 15/06/26 REGS | 475,167   | 511,839   | 0.10     |
| GBP                     | 350,000                    | VMED O2 UK FI 4.5000% 15/07/31 REGS | 487,396   | 485,962   | 0.09     |
| EUR                     | 335,000                    | JAGUAR LAND R 6.8750% 15/11/26 REGS | 451,270   | 463,520   | 0.09     |
| GBP                     | 300,000                    | MORRISON(WM) 4.7500% 04/07/29 EMTN  | 465,415   | 459,089   | 0.09     |
| EUR                     | 400,000                    | ELLAKTOR VALU 6.3750% 15/12/24 REGS | 449,198   | 458,078   | 0.09     |
| USD                     | 400,000                    | HTA GROUP LTD 7.0000% 18/12/25 REGS | 416,960   | 425,512   | 0.08     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨              | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価       | 評価金額       | 純資産比率(%) |
|-----------------|----------------------------|-------------------------------------|------------|------------|----------|
| EUR             | 340,000                    | NOMAD FOODS B 2.5000% 24/06/28 REGS | 412,267    | 408,183    | 0.08     |
| USD             | 400,000                    | VMED O2 UK FI 4.2500% 31/01/31 144A | 400,000    | 392,952    | 0.07     |
| GBP             | 250,000                    | ARQIVA BROAD FIN 6.7500% 30/09/23   | 327,825    | 354,951    | 0.07     |
| EUR             | 290,000                    | VICTORIA PLC 3.7500% 15/03/28       | 343,868    | 350,361    | 0.07     |
| USD             | 300,000                    | INTL GAME TEC 5.2500% 15/01/29 144A | 303,750    | 321,750    | 0.06     |
| USD             | 300,000                    | TULLOW OIL P 10.2500% 15/05/26 REGS | 300,000    | 314,790    | 0.06     |
| USD             | 300,000                    | NAK NAFTOGAZ 7.6250% 08/11/26 REGS  | 300,000    | 310,052    | 0.06     |
| EUR             | 250,000                    | NAK NAFTOGAZ 7.1250% 19/07/24       | 304,205    | 308,682    | 0.06     |
| EUR             | 250,000                    | VMED O2 UK FI 3.2500% 31/01/31 REGS | 315,652    | 298,227    | 0.06     |
| GBP             | 204,000                    | DEUCE FINCO 5.5000% 15/06/27 REGS   | 287,528    | 282,163    | 0.05     |
| GBP             | 200,000                    | NEMEAN BONDCO 7.375% 01/02/24 REGS  | 281,684    | 279,822    | 0.05     |
| EUR             | 200,000                    | INEOS QUATTRO 3.7500% 15/07/26 REGS | 242,670    | 244,849    | 0.05     |
| EUR             | 200,000                    | EG GLOBAL 6.2500% 30/10/25 REGS     | 241,696    | 243,733    | 0.05     |
| GBP             | 170,000                    | INSPIRED ENTE 7.8750% 01/06/26 REGS | 239,930    | 241,014    | 0.05     |
| USD             | 200,000                    | SOUTHERN GAS CO 6.875% 24/03/26 RE  | 240,500    | 239,040    | 0.05     |
| GBP             | 160,000                    | PREMIER FOODS 3.5000% 15/10/26      | 226,904    | 221,304    | 0.04     |
| USD             | 200,000                    | ROLLS-ROYCE P 5.7500% 15/10/27 144A | 200,000    | 219,500    | 0.04     |
| GBP             | 160,000                    | TALKTALK TELECOM 3.8750% 20/02/25   | 207,104    | 218,007    | 0.04     |
| USD             | 200,000                    | VIRGIN MEDIA 5.5000% 15/05/29 144A  | 203,750    | 215,000    | 0.04     |
| GBP             | 151,000                    | PINEWOOD FINA 3.2500% 30/09/25 REGS | 209,417    | 212,226    | 0.04     |
| USD             | 200,000                    | TRANSDIGM UK HLD 6.8750% 15/05/26   | 195,250    | 211,000    | 0.04     |
| USD             | 200,000                    | UKRAINE RAIL 8.2500% 09/07/24       | 200,000    | 210,300    | 0.04     |
| USD             | 200,000                    | MODULAIRE GL 10.0000% 15/08/23 144A | 188,016    | 207,750    | 0.04     |
| USD             | 200,000                    | EG GLOBAL 6.7500% 07/02/25 144A     | 200,000    | 206,793    | 0.04     |
| USD             | 200,000                    | ALGECO GLOBAL 8.0000% 15/02/23 144A | 195,994    | 205,123    | 0.04     |
| USD             | 200,000                    | ATLANTIC SUST 4.1250% 15/06/28 144A | 201,000    | 203,760    | 0.04     |
| USD             | 200,000                    | GAZPROM PJSC 3.0000% 29/06/27       | 200,740    | 202,876    | 0.04     |
| USD             | 200,000                    | FRESNILLO PLC 4.2500% 02/10/50 REGS | 196,010    | 201,500    | 0.04     |
| USD             | 200,000                    | VIRGIN MEDIA 5.0000% 15/07/30 144A  | 209,500    | 201,000    | 0.04     |
| USD             | 200,000                    | NMG FINCO PLC 5.7500% 01/08/22 144A | 200,000    | 199,314    | 0.04     |
| EUR             | 160,000                    | TI AUTOMOTIVE 3.7500% 15/04/29 REGS | 190,472    | 194,057    | 0.04     |
| EUR             | 160,000                    | VICTORIA PLC 3.6250% 24/08/26       | 194,360    | 192,907    | 0.04     |
| GBP             | 130,000                    | BOPARAN FINAN 7.6250% 30/11/25 REGS | 172,425    | 163,627    | 0.03     |
| EUR             | 130,000                    | DRAX FINCO PLC 2.6250% 01/11/25     | 154,011    | 160,515    | 0.03     |
| GBP             | 100,000                    | ROLLS-ROYCE P 5.7500% 15/10/27 REGS | 137,862    | 151,397    | 0.03     |
| GBP             | 100,000                    | BELLIS FINCO 4.0000% 16/02/27 REGS  | 138,195    | 138,315    | 0.03     |
| USD             | 125,000                    | TECHNIPFMC 6.5000% 01/02/26 144A    | 125,000    | 135,625    | 0.03     |
| 合計：イギリス         |                            |                                     | 19,601,198 | 20,334,249 | 3.85     |
|                 |                            |                                     | 22,997,786 | 23,458,257 | 4.45     |
| <b>アメリカ</b>     |                            |                                     |            |            |          |
| <b>バンクローン</b>   |                            |                                     |            |            |          |
| USD             | 17,877                     | PARKER DRILLING FRN 26/03/24 TL     | 0          | 16,804     | 0.00     |
| USD             | 102,642                    | GLOBAL AVIATION FRN 13/01/18 2ND TL | 585,198    | 0          | 0.00     |
|                 |                            |                                     | 585,198    | 16,804     | 0.00     |
| <b>コール・ワラント</b> |                            |                                     |            |            |          |
| —               | 431                        | DENBURY-CW25                        | 1,585      | 19,998     | 0.00     |
|                 |                            |                                     | 1,585      | 19,998     | 0.00     |
| <b>転換社債</b>     |                            |                                     |            |            |          |
| USD             | 7                          | GULFPORT ENERGY - P CV PIK 29/12/49 | 22,865     | 31,745     | 0.01     |
|                 |                            |                                     | 22,865     | 31,745     | 0.01     |
| <b>変動金利債</b>    |                            |                                     |            |            |          |
| USD             | 900,000                    | ILFC E CAP TRUST I FRN 21/12/65 144 | 648,000    | 746,999    | 0.15     |
| USD             | 150,000                    | CITIGROUP INC FRN 29/12/49 T        | 150,000    | 175,136    | 0.03     |
| USD             | 125,000                    | JPMORGAN CHASE FRN 01/08/69 HH      | 125,000    | 129,378    | 0.02     |
| EUR             | 100,000                    | FORD MOTOR CRED FRN 15/11/23 EMTN   | 98,202     | 117,244    | 0.02     |
| USD             | 100,000                    | CITIGROUP INC FRN 30/07/69 V        | 94,800     | 103,185    | 0.02     |
| USD             | 75,000                     | BANK OF AMERICA FRN 29/12/49 DD     | 75,000     | 87,203     | 0.02     |
| USD             | 75,000                     | BANK OF AMER CRP FRN 20/12/69 JJ    | 75,000     | 79,875     | 0.02     |
| USD             | 75,000                     | CITIGROUP INC FRN 10/03/70 W        | 75,000     | 77,531     | 0.01     |
|                 |                            |                                     | 1,341,002  | 1,516,551  | 0.29     |
| <b>普通株式</b>     |                            |                                     |            |            |          |
| —               | 1,272                      | HOLDCO MEMBERSHIP INTERESTS         | 1          | 1,002,055  | 0.19     |
| —               | 40,404                     | HERTZ CORP DUMMY                    | 404,040    | 404,041    | 0.08     |
| —               | 15,992                     | HEXION HOLDINGS                     | 795,847    | 295,853    | 0.06     |
| —               | 2,476                      | GULFPORT ENERGY                     | 130,041    | 158,465    | 0.03     |
| —               | 12,050                     | UCI HOLDINGS INC COMMON STOCK       | 191,390    | 144,600    | 0.03     |
| —               | 3,910                      | FTS INTERNAT-A                      | 125,942    | 113,019    | 0.02     |
| —               | 364                        | FERRELLGAS PAR-B                    | 96,000     | 75,712     | 0.01     |
| —               | 968                        | PARKER DRILLING                     | 50,870     | 5,614      | 0.00     |

| 通貨                      | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価      | 評価金額      | 純資産比率(%) |
|-------------------------|----------------------------|-------------------------------------|-----------|-----------|----------|
| —                       | 6,580                      | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK E     | 0         | 3,915     | 0.00     |
| —                       | 6,580                      | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK H     | 0         | 3,915     | 0.00     |
| —                       | 6,580                      | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK J     | 0         | 3,915     | 0.00     |
| —                       | 6,580                      | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK F     | 0         | 3,915     | 0.00     |
| —                       | 6,580                      | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK A     | 0         | 3,915     | 0.00     |
| —                       | 6,580                      | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK B     | 0         | 3,915     | 0.00     |
| —                       | 6,580                      | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK C     | 0         | 3,915     | 0.00     |
| —                       | 6,580                      | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK G     | 0         | 3,915     | 0.00     |
| —                       | 6,580                      | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK D     | 0         | 3,915     | 0.00     |
| —                       | 6,580                      | NOVASEP HOLDINGS COMMON STOCK I     | 0         | 3,915     | 0.00     |
| —                       | 9,727                      | BLUESTEM GROUP INC                  | 178,196   | 3,404     | 0.00     |
| —                       | 7,489                      | WARREN RESOURCES INC                | 0         | 75        | 0.00     |
| —                       | 10,289                     | NINE POINT ENERGY HDG DUMMY         | 475,000   | 0         | 0.00     |
| —                       | 31,430                     | HERCULES OFFSHORE INC ESC           | 1,825,802 | 0         | 0.00     |
| —                       | 22,715                     | DIRECTBUY HDGS INC RESTR CO (BONY)  | 386,155   | 0         | 0.00     |
| —                       | 175                        | CLOUD PEAK ENERG                    | 0         | 0         | 0.00     |
|                         |                            |                                     | 4,659,284 | 2,241,988 | 0.42     |
| <b>その他債券</b>            |                            |                                     |           |           |          |
| USD                     | 380,000                    | AMERICAN AIRL 5.7500% 20/04/29 144A | 393,490   | 409,374   | 0.07     |
| USD                     | 190,000                    | AMERICAN AIRL 5.5000% 20/04/26 144A | 191,225   | 201,519   | 0.04     |
| USD                     | 186,708                    | AMC ENTMNT HOLDI PIK 15/06/26 144A  | 204,971   | 191,259   | 0.04     |
| USD                     | 75,000                     | DELTA/SKYMILE 4.7500% 20/10/28 144A | 75,000    | 83,505    | 0.02     |
| USD                     | 50,000                     | UNTD AIR 20-1 5.8750% 15/10/27 20-1 | 47,582    | 52,817    | 0.01     |
| USD                     | 100,000                    | JC PENNEY COR 8.6250% 15/03/25 144A | 99,815    | 20        | 0.00     |
|                         |                            |                                     | 1,012,083 | 938,494   | 0.18     |
| <b>バイ・イン・カインド(PIK)債</b> |                            |                                     |           |           |          |
| USD                     | 405,000                    | WHITE CAP PAR PIK 15/03/26 144A     | 402,825   | 419,037   | 0.08     |
| USD                     | 236,000                    | IRIS HLDING INC PIK 15/02/26 144A   | 236,000   | 240,720   | 0.05     |
| USD                     | 230,000                    | BCPE ULYSSES PIK 01/04/27 144A      | 229,571   | 235,750   | 0.04     |
| USD                     | 155,000                    | CORE & MAIN HOLD PIK 15/09/24 144A  | 150,275   | 158,100   | 0.03     |
|                         |                            |                                     | 1,018,671 | 1,053,607 | 0.20     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b>      |                            |                                     |           |           |          |
| EUR                     | 1,000,000                  | NETFLIX INC 3.8750% 15/11/29 REGS   | 1,221,204 | 1,432,583 | 0.28     |
| EUR                     | 1,101,000                  | ORGANON & CO/ 2.8750% 30/04/28 REGS | 1,326,887 | 1,328,317 | 0.26     |
| USD                     | 1,000,000                  | SASOL FINANCING 5.5000% 18/03/31    | 999,999   | 1,053,499 | 0.21     |
| USD                     | 975,000                    | KOSMOS ENERGY 7.5000% 01/03/28 REGS | 974,999   | 962,812   | 0.19     |
| EUR                     | 800,000                    | SUPERIOR IND 6.0000% 15/06/25 REGS  | 891,092   | 961,086   | 0.19     |
| USD                     | 850,000                    | CNOOC FIN 2015 US 3.5% 05/05/25     | 879,393   | 908,116   | 0.18     |
| USD                     | 800,000                    | FORD MOTOR CRED 5.1130% 03/05/29    | 663,499   | 894,543   | 0.18     |
| USD                     | 705,000                    | FORD MOTOR CO 9.0000% 22/04/25      | 816,919   | 868,912   | 0.17     |
| USD                     | 770,000                    | CSC HOLDINGS 4.6250% 01/12/30 144A  | 786,300   | 754,068   | 0.15     |
| EUR                     | 500,000                    | NETFLIX INC 4.6250% 15/05/29        | 590,674   | 743,068   | 0.15     |
| EUR                     | 600,000                    | CHEMOURS CO 4.0000% 15/05/26        | 696,708   | 730,569   | 0.15     |
| USD                     | 710,000                    | DIEBOLD INC 8.5% 15/04/24 WI        | 694,403   | 726,862   | 0.15     |
| EUR                     | 600,000                    | BWAY HOLDING 4.7500% 15/04/24 REGS  | 682,542   | 712,681   | 0.15     |
| USD                     | 725,000                    | BWAY HDGS CO 7.25% 15/04/25 144a    | 717,015   | 710,499   | 0.14     |
| USD                     | 665,000                    | CP ATLAS BUYE 7.0000% 01/12/28 144A | 688,174   | 690,502   | 0.14     |
| USD                     | 595,000                    | CAESARS ENT 8.1250% 01/07/27 144A   | 609,890   | 663,763   | 0.14     |
| USD                     | 645,000                    | CRESTWOOD MID 5.6250% 01/05/27 144A | 609,990   | 661,350   | 0.14     |
| USD                     | 610,000                    | INNPHOS HOLD 9.3750% 15/02/28 144A  | 622,524   | 658,799   | 0.13     |
| EUR                     | 500,000                    | KRAFT HEINZ 2.25% 25/05/28          | 636,386   | 647,150   | 0.13     |
| USD                     | 625,000                    | SWITCH LTD 3.7500% 15/09/28 144A    | 635,374   | 632,812   | 0.13     |
| USD                     | 585,000                    | NAVIENT CORP 5.875% 25/10/24        | 590,068   | 629,377   | 0.12     |
| USD                     | 550,000                    | CNOOC FINANCE 4.3750% 02/05/28      | 607,144   | 620,048   | 0.12     |
| EUR                     | 500,000                    | KRONOS INTL I 3.7500% 15/09/25 REGS | 579,760   | 606,950   | 0.12     |
| USD                     | 575,000                    | INDIGO NAT RE 5.3750% 01/02/29 144A | 574,341   | 600,874   | 0.11     |
| EUR                     | 491,000                    | COTY INC 3.8750% 15/04/26 REGS      | 598,037   | 586,530   | 0.11     |
| USD                     | 525,000                    | DCP MIDSTREAM OP 5.1250% 15/05/29   | 543,093   | 581,368   | 0.11     |
| USD                     | 625,000                    | EXTERRAN SOL/FI 8.1250% 01/05/25 WI | 604,749   | 553,124   | 0.10     |
| USD                     | 510,000                    | ALLEN MEDIA 10.5000% 15/02/28 144A  | 459,099   | 541,874   | 0.10     |
| USD                     | 515,000                    | DAVITA INC 4.6250% 01/06/30 144A    | 519,843   | 528,626   | 0.10     |
| USD                     | 535,000                    | ENDURANCE ACQ 6.0000% 15/02/29 144A | 522,577   | 522,962   | 0.10     |
| USD                     | 475,000                    | LIFE TIME INC 8.0000% 15/04/26 144A | 479,947   | 507,655   | 0.10     |
| USD                     | 450,000                    | GRANITE US H 11.0000% 01/10/27 144A | 469,708   | 501,749   | 0.10     |
| USD                     | 500,000                    | GATEWAY CASINO 8.25% 01/03/24 144A  | 493,999   | 499,999   | 0.09     |
| USD                     | 465,000                    | TENET HEALTHC 6.1250% 01/10/28 144A | 464,999   | 495,522   | 0.09     |
| USD                     | 475,000                    | TRANSDIGM INC 5.5000% 15/11/27      | 465,112   | 495,187   | 0.09     |
| USD                     | 485,000                    | ASSUREDPARTNE 7.0000% 15/08/25 144A | 473,267   | 494,093   | 0.09     |
| USD                     | 475,000                    | ICAHN ENTER/FIN 5.2500% 15/05/27 WI | 460,014   | 490,902   | 0.09     |
| USD                     | 475,000                    | AUSTIN BIDCO 7.1250% 15/12/28 144A  | 490,125   | 486,727   | 0.09     |
| USD                     | 465,000                    | NEXSTAR BROAD 4.7500% 01/11/28 144A | 466,463   | 478,077   | 0.09     |
| USD                     | 465,000                    | MPH ACQUISITI 5.7500% 01/11/28 144A | 456,812   | 467,282   | 0.09     |

| 通貨  | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価    | 評価金額    | 純資産比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|---------|----------|
| USD | 370,000                    | AMERICAN AIR 11.7500% 15/07/25 144A | 374,793 | 464,349 | 0.09     |
| USD | 450,000                    | ORGANON FIN 1 5.1250% 30/04/31 144A | 450,000 | 463,499 | 0.09     |
| USD | 450,000                    | ADTALEM GLOBA 5.5000% 01/03/28 144A | 450,488 | 457,874 | 0.09     |
| USD | 300,000                    | SPRINT CAP CORP 8.7500% 15/03/32    | 357,235 | 455,249 | 0.09     |
| USD | 450,000                    | GOLDEN NUGGET 6.7500% 15/10/24 144A | 447,172 | 454,598 | 0.09     |
| USD | 445,000                    | STAPLES INC 10.7500% 15/04/27 144A  | 439,485 | 453,899 | 0.09     |
| USD | 435,000                    | BOYD GAMING C 4.7500% 15/06/31 144A | 435,000 | 452,060 | 0.09     |
| USD | 425,000                    | ICAHN ENTER/FIN 6.2500% 15/05/26 WI | 410,612 | 450,499 | 0.09     |
| USD | 425,000                    | LAREDO PETROLEUM 9.5000% 15/01/25   | 304,511 | 448,374 | 0.08     |
| USD | 435,000                    | SBA COMMUNICATIO 3.8750% 15/02/27   | 440,113 | 447,681 | 0.08     |
| USD | 475,000                    | ASP AMC MERGER SUB 8% 15/05/25 144A | 450,388 | 446,499 | 0.08     |
| USD | 425,000                    | ENLINK MIDSTREAM PRT 4.85% 15/07/26 | 391,379 | 439,874 | 0.08     |
| USD | 425,000                    | IMOLA MERGER 4.7500% 15/05/29 144A  | 425,000 | 437,218 | 0.08     |
| USD | 400,000                    | NBM US HOLDIN 7.0000% 14/05/26 REGS | 393,969 | 431,203 | 0.08     |
| USD | 350,000                    | HCA INC 7.69% 15/06/25              | 394,625 | 425,232 | 0.08     |
| USD | 405,000                    | TENET HEALTHC 5.1250% 01/11/27 144A | 390,737 | 424,743 | 0.08     |
| USD | 400,000                    | MGIC INVT CORP 5.2500% 15/08/28     | 422,063 | 424,503 | 0.08     |
| USD | 425,000                    | GENWORTH HOLDING 4.8000% 15/02/24   | 419,688 | 423,937 | 0.08     |
| USD | 395,000                    | DISH DBS CORP 5.875% 15/11/24       | 368,924 | 422,649 | 0.08     |
| USD | 402,000                    | RADIATE HOLDC 6.5000% 15/09/28 144A | 411,269 | 421,922 | 0.08     |
| USD | 361,000                    | OCCIDENTAL PETE 6.3750% 01/09/28    | 350,125 | 418,759 | 0.08     |
| EUR | 340,000                    | IQVIA INC 2.8750% 15/06/28 REGS     | 385,662 | 416,805 | 0.08     |
| USD | 400,000                    | VERITAS US 10.5% 01/02/24 144A      | 420,750 | 410,499 | 0.08     |
| USD | 395,000                    | STAPLES INC 7.5000% 15/04/26 144A   | 355,331 | 410,305 | 0.08     |
| USD | 390,000                    | NOVELIS CORP 4.7500% 30/01/30 144A  | 392,947 | 409,499 | 0.08     |
| USD | 390,000                    | CHENIERE ENER 4.0000% 01/03/31 144A | 391,513 | 407,549 | 0.08     |
| USD | 350,000                    | SPRINGLEAF FIN 7.1250% 15/03/26     | 344,094 | 407,312 | 0.08     |
| USD | 420,000                    | PARK RIVER HO 5.6250% 01/02/29 144A | 418,288 | 406,349 | 0.08     |
| USD | 390,000                    | CENTURYLINK I 5.1250% 15/12/26 144A | 397,350 | 406,211 | 0.08     |
| USD | 385,000                    | CHENIERE ENER 4.6250% 15/10/28 144A | 393,581 | 406,174 | 0.08     |
| USD | 400,000                    | NATIONSTAR MT 5.5000% 15/08/28 144A | 401,250 | 403,979 | 0.08     |
| USD | 370,000                    | WHITE CAP BUY 6.8750% 15/10/28 144A | 376,750 | 395,992 | 0.08     |
| USD | 381,000                    | CROWNROCK LP/ 5.6250% 15/10/25 144A | 349,964 | 394,811 | 0.07     |
| USD | 360,000                    | CCO HOLDINGS 5.3750% 01/06/29 144A  | 377,986 | 392,400 | 0.07     |
| USD | 325,000                    | HCA INC 7.58% 15/09/25 MTN          | 359,938 | 391,625 | 0.07     |
| USD | 370,000                    | IRON MOUNTAIN 5.2500% 15/07/30 144A | 376,019 | 390,813 | 0.07     |
| USD | 385,000                    | LEVEL 3 FIN I 4.2500% 01/07/28 144A | 388,131 | 390,740 | 0.07     |
| USD | 350,000                    | CHS/COMMUNITY 8.0000% 15/12/27 144A | 364,000 | 389,393 | 0.07     |
| USD | 375,000                    | CCO HOLDINGS LL 4.5000% 01/05/32 WI | 389,106 | 387,188 | 0.07     |
| USD | 375,000                    | STANDARD INDS 4.3750% 15/07/30 144A | 375,313 | 386,719 | 0.07     |
| USD | 370,000                    | CCO HOLDINGS 4.5000% 15/08/30 144A  | 377,630 | 385,677 | 0.07     |
| USD | 375,000                    | OCCIDENTAL PETE 3.4500% 15/07/24    | 332,813 | 382,500 | 0.07     |
| USD | 375,000                    | PARK-OHIO INDUST 6.6250% 15/04/27   | 341,188 | 381,675 | 0.07     |
| USD | 350,000                    | FREEPORT-MCMORAN 4.2500% 01/03/30   | 347,813 | 375,025 | 0.07     |
| EUR | 310,000                    | IQVIA INC 2.2500% 15/01/28 REGS     | 345,387 | 371,098 | 0.07     |
| EUR | 290,000                    | FORD MOTOR CR 3.2500% 15/09/25 EMTN | 342,432 | 369,720 | 0.07     |
| USD | 355,000                    | NRG ENERGY 6.625% 15/01/27 WI       | 365,183 | 367,425 | 0.07     |
| USD | 385,000                    | TEAM HEALTH H 6.3750% 01/02/25 144A | 348,794 | 366,158 | 0.07     |
| USD | 340,000                    | HAWAIIAN BRAN 5.7500% 20/01/26 144A | 345,610 | 365,500 | 0.07     |
| EUR | 300,000                    | WMG ACQUISITI 2.7500% 15/07/28 REGS | 338,175 | 365,367 | 0.07     |
| USD | 350,000                    | RADIATE HOLDC 4.5000% 15/09/26 144A | 352,100 | 362,296 | 0.07     |
| USD | 350,000                    | VISTRA OPERAT 5.0000% 31/07/27 144A | 360,435 | 357,875 | 0.07     |
| USD | 342,000                    | CINEMARK USA 5.2500% 15/07/28 144A  | 342,625 | 350,550 | 0.07     |
| USD | 275,000                    | L BRANDS 6.75% 01/07/36             | 278,563 | 344,438 | 0.07     |
| USD | 335,000                    | CALPINE CORP 4.5000% 15/02/28 144A  | 325,614 | 341,700 | 0.06     |
| USD | 325,000                    | NFP CORP 6.8750% 15/08/28 144A      | 327,625 | 341,335 | 0.06     |
| USD | 325,000                    | CASTLE US HOL 9.5000% 15/02/28 144A | 325,000 | 338,813 | 0.06     |
| USD | 325,000                    | MURPHY OIL CORP 5.8750% 01/12/27    | 315,125 | 338,585 | 0.06     |
| USD | 335,000                    | DYCOM INDS 4.5000% 15/04/29 144A    | 335,338 | 337,901 | 0.06     |
| USD | 325,000                    | PATTERN ENERG 4.5000% 15/08/28 144A | 333,469 | 336,440 | 0.06     |
| USD | 315,000                    | AMWINS GROUP 7.7500% 01/07/26 144A  | 321,650 | 334,105 | 0.06     |
| USD | 325,000                    | DELEK LOG PT/FI 6.7500% 15/05/25 WI | 318,490 | 333,938 | 0.06     |
| USD | 325,000                    | NEWS CORP 3.8750% 15/05/29 144A     | 326,875 | 328,949 | 0.06     |
| USD | 320,000                    | TERRAFORM POW 4.7500% 15/01/30 144A | 322,306 | 327,734 | 0.06     |
| USD | 305,000                    | DEALER TIRE L 8.0000% 01/02/28 144A | 299,077 | 327,113 | 0.06     |
| USD | 325,000                    | CHS/COMMUNITY 4.7500% 15/02/31 144A | 325,000 | 325,406 | 0.06     |
| USD | 300,000                    | WYNN LAS VEGAS 5.5% 01/03/25 144A   | 281,250 | 323,058 | 0.06     |
| USD | 294,000                    | MGM RESORTS 5.5000% 15/04/27        | 313,641 | 322,665 | 0.06     |
| USD | 295,000                    | SIRIUS XM RAD 5.5000% 01/07/29 144A | 300,657 | 321,093 | 0.06     |
| USD | 325,000                    | MIDAS INT HOLD 7.875% 01/10/22 144A | 313,272 | 316,063 | 0.06     |
| GBP | 221,000                    | MPT OP PTNR/FINL 3.3750% 24/04/30   | 305,220 | 315,772 | 0.06     |
| USD | 300,000                    | CCO HOLDINGS 5.0000% 01/02/28 144A  | 314,119 | 314,865 | 0.06     |
| USD | 300,000                    | STL HOLDING C 7.5000% 15/02/26 144A | 307,125 | 313,500 | 0.06     |
| USD | 235,000                    | OCCIDENTAL PETE 8.8750% 15/07/30    | 247,106 | 313,452 | 0.06     |
| USD | 310,000                    | WW INTERNATIO 4.5000% 15/04/29 144A | 310,000 | 312,325 | 0.06     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨  | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価    | 評価金額    | 純資産比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|---------|----------|
| USD | 300,000                    | TEGNA INC 4.6250% 15/03/28          | 300,000 | 311,250 | 0.06     |
| USD | 300,000                    | IHEARTCOMMUNI 4.7500% 15/01/28 144A | 293,250 | 308,625 | 0.06     |
| EUR | 260,000                    | IQVIA INC 2.2500% 15/03/29 REGS     | 314,418 | 308,560 | 0.06     |
| USD | 305,000                    | VISTRA OPERAT 4.3750% 01/05/29 144A | 305,056 | 307,129 | 0.06     |
| USD | 300,000                    | ACRISURE LLC 7.0000% 15/11/25 144A  | 300,000 | 306,000 | 0.06     |
| USD | 292,000                    | ARCHROCK LP/F 6.2500% 01/04/28 144A | 300,141 | 304,410 | 0.06     |
| USD | 290,000                    | TEGNA INC 5.0000% 15/09/29          | 284,846 | 301,841 | 0.06     |
| USD | 290,000                    | COVANTA HOLDING 6.0000% 01/01/27    | 243,594 | 301,600 | 0.06     |
| USD | 290,000                    | ASHTON WOODS 6.7500% 01/08/25 144A  | 293,775 | 300,513 | 0.06     |
| USD | 255,000                    | OCCIDENTAL PETE 6.1250% 01/01/31    | 256,050 | 299,306 | 0.06     |
| USD | 281,000                    | CHS/COMMUNITY 6.6250% 15/02/25 144A | 265,870 | 297,155 | 0.06     |
| EUR | 250,000                    | FORD MOTOR CR 1.3550% 07/02/25 EMTN | 282,104 | 297,147 | 0.06     |
| USD | 300,000                    | PBF LOGIST LP/FIN 6.875% 15/5/23 WI | 302,813 | 294,750 | 0.06     |
| USD | 275,000                    | US STEEL CORP 6.8750% 01/03/29      | 281,188 | 294,250 | 0.06     |
| USD | 272,000                    | TAYLOR MORRIS 5.1250% 01/08/30 144A | 289,331 | 294,100 | 0.06     |
| USD | 290,000                    | TRANSDIGM INC 4.8750% 01/05/29 144A | 290,000 | 292,900 | 0.06     |
| EUR | 240,000                    | AVANTOR FUNDI 2.6250% 01/11/25 REGS | 280,272 | 292,291 | 0.06     |
| USD | 275,000                    | ALLIED UNIVER 6.6250% 15/07/26 144A | 280,271 | 291,844 | 0.06     |
| USD | 275,000                    | NEXTERA ENERG 3.8750% 15/10/26 144A | 275,000 | 290,469 | 0.06     |
| USD | 270,000                    | ARCONIC ROLLE 6.1250% 15/02/28 144A | 261,775 | 289,575 | 0.05     |
| USD | 280,000                    | KAISER ALUMIN 4.6250% 01/03/28 144A | 268,313 | 288,750 | 0.05     |
| USD | 280,000                    | GREYSTAR REAL 5.7500% 01/12/25 144A | 285,793 | 288,431 | 0.05     |
| USD | 255,000                    | SCIENTIFIC GA 7.2500% 15/11/29 144A | 267,850 | 287,640 | 0.05     |
| USD | 275,000                    | TRIDENT TPI H 9.2500% 01/08/24 144A | 259,155 | 287,375 | 0.05     |
| USD | 275,000                    | VIPER ENERGY 5.3750% 01/11/27 144A  | 272,250 | 287,375 | 0.05     |
| USD | 275,000                    | CITGO PETROLE 7.0000% 15/06/25 144A | 277,500 | 286,688 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | NMI HOLDINGS 7.3750% 01/06/25 144A  | 260,563 | 286,490 | 0.05     |
| USD | 285,000                    | CABLE ONE INC 4.0000% 15/11/30 144A | 292,175 | 286,069 | 0.05     |
| USD | 277,000                    | SIZZLING PLAT 8.5000% 28/11/25 144A | 284,426 | 286,003 | 0.05     |
| USD | 269,000                    | EDGEWELL PERS 5.5000% 01/06/28 144A | 270,496 | 285,813 | 0.05     |
| USD | 275,000                    | CSC HOLDINGS 5.7500% 15/01/30 144A  | 278,371 | 285,656 | 0.05     |
| USD | 285,000                    | POLAR US BORR 6.7500% 15/05/26 144A | 285,000 | 285,356 | 0.05     |
| USD | 275,000                    | LOGAN MERGER 5.5000% 01/09/27 144A  | 280,250 | 285,313 | 0.05     |
| USD | 265,000                    | EQT CORP 3.9000% 01/10/27           | 244,563 | 283,881 | 0.05     |
| USD | 225,000                    | OCCIDENTAL PETE 7.5000% 01/05/31    | 169,659 | 281,250 | 0.05     |
| USD | 270,000                    | FREEDOM MORTG 7.6250% 01/05/26 144A | 278,288 | 281,070 | 0.05     |
| USD | 275,000                    | CCO HOLDINGS 4.2500% 01/02/31 144A  | 277,933 | 280,772 | 0.05     |
| USD | 275,000                    | LADDER CAP FI 5.2500% 01/10/25 144A | 266,554 | 280,500 | 0.05     |
| USD | 265,000                    | HARSCO CORP 5.7500% 31/07/27 144A   | 264,006 | 278,250 | 0.05     |
| USD | 260,000                    | SOUTHWESTERN ENE 7.5000% 01/04/26   | 211,004 | 276,130 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | ALLIED UNIVER 9.7500% 15/07/27 144A | 247,935 | 275,313 | 0.05     |
| USD | 275,000                    | LADDER CAP FI 4.2500% 01/02/27 144A | 265,894 | 274,425 | 0.05     |
| USD | 270,000                    | CHS/COMMUNITY 6.1250% 01/04/30 144A | 270,000 | 274,050 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | FREEPORT-MCMORAN 4.6250% 01/08/30   | 252,888 | 273,750 | 0.05     |
| USD | 260,000                    | CLEAR CHANNEL 7.7500% 15/04/28 144A | 260,100 | 272,355 | 0.05     |
| USD | 270,000                    | LBM ACQUISITI 6.2500% 15/01/29 144A | 272,462 | 272,079 | 0.05     |
| USD | 255,000                    | PRIME SEC/FIN 6.2500% 15/01/28 144A | 250,546 | 271,256 | 0.05     |
| USD | 245,000                    | CSC HOLDINGS 6.5000% 01/02/29 144A  | 245,000 | 271,031 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | MACY'S RETAIL 5.8750% 01/04/29 144A | 252,063 | 268,858 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | CNX RESOURCES 7.2500% 14/03/27 144A | 263,750 | 268,125 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | FORD MOTOR CO 4.7500% 15/01/43      | 255,313 | 266,250 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | CAESARS ENT 6.2500% 01/07/25 144A   | 250,000 | 264,875 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | WASH MULT ACQ 5.7500% 15/04/26 144A | 254,750 | 261,025 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | WERNER LP/INC 8.7500% 15/07/25 144A | 250,000 | 260,625 | 0.05     |
| USD | 260,000                    | PRIMO WATER H 4.3750% 30/04/29 144A | 260,000 | 260,000 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | CQP HOLDCO LP/BI 5.5000% 15/06/31   | 250,000 | 260,000 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | NCR CORP 5.2500% 01/10/30 144A      | 262,000 | 259,375 | 0.05     |
| USD | 240,000                    | GRAHAM PKG CO 7.1250% 15/08/28 144A | 251,593 | 258,600 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | IRON MOUNTAIN 4.8750% 15/09/29 144A | 252,188 | 258,050 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | CENTENE CORP 3.0000% 15/10/30       | 249,875 | 256,558 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | CCO HOLDINGS 4.5000% 01/06/33 144A  | 248,688 | 255,815 | 0.05     |
| USD | 222,000                    | FXI HOLDINGS 12.2500% 15/11/26 144A | 218,102 | 255,578 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | CITGO HOLDING 9.2500% 01/08/24 144A | 251,635 | 255,000 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | BRAND ENERGY 8.5000% 15/07/25 144A  | 253,506 | 254,183 | 0.05     |
| USD | 255,000                    | PLANTRONICS I 4.7500% 01/03/29 144A | 250,763 | 253,146 | 0.05     |
| USD | 235,000                    | UNITED NATURA 6.7500% 15/10/28 144A | 240,325 | 252,898 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | WHEEL PROS IN 6.5000% 15/05/29 144A | 251,750 | 252,559 | 0.05     |
| USD | 257,000                    | NRG ENERGY IN 3.6250% 15/02/31 144A | 263,639 | 252,554 | 0.05     |
| USD | 240,000                    | CROWNROCK LP/ 5.0000% 01/05/29 144A | 242,063 | 252,060 | 0.05     |
| USD | 244,000                    | MATADOR RESOURC 5.8750% 15/09/26 WI | 237,153 | 251,271 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | SINCLAIR TELE 5.125% 15/02/27 144A  | 250,000 | 250,938 | 0.05     |
| USD | 205,000                    | FREEPORT-MCMORAN 5.45% 15/03/43     | 214,915 | 250,863 | 0.05     |
| USD | 245,000                    | DAE FUNDING L 3.3750% 20/03/28 REGS | 241,842 | 250,410 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | UNITED WHOLES 5.5000% 15/04/29 144A | 249,625 | 250,095 | 0.05     |
| USD | 225,000                    | BIG RVR STL/F 6.6250% 31/01/29 144A | 231,031 | 249,188 | 0.05     |

| 通貨  | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価    | 評価金額    | 純資産比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|---------|----------|
| USD | 200,000                    | BRASKEM AMERI 7.1250% 22/07/41 REGS | 241,750 | 248,500 | 0.05     |
| USD | 235,000                    | WESTERN MIDSTRM 4.3500% 01/02/25    | 209,400 | 248,447 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | SYNEOS HEALTH 3.6250% 15/01/29 144A | 252,250 | 247,500 | 0.05     |
| USD | 380,000                    | DIAMOND SPORT 5.3750% 15/08/26 144A | 349,874 | 246,506 | 0.05     |
| USD | 225,000                    | ALLEGHENY LUDLUM 6.9500% 15/12/25   | 243,844 | 246,375 | 0.05     |
| USD | 235,000                    | GATES GLOBAL 6.2500% 15/01/26 144A  | 228,934 | 246,166 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | COEUR MINING 5.1250% 15/02/29 144A  | 242,563 | 245,800 | 0.05     |
| USD | 225,000                    | HARVEST MIDST 7.5000% 01/09/28 144A | 227,625 | 244,969 | 0.05     |
| USD | 250,000                    | HAT HOLDINGS 3.7500% 15/09/30 144A  | 253,966 | 244,063 | 0.05     |
| USD | 225,000                    | GRAY TELE INC 7.0000% 15/05/27 144A | 234,077 | 243,281 | 0.05     |
| USD | 235,000                    | TENET HEALTHC 4.6250% 15/06/28 144A | 239,400 | 241,862 | 0.05     |
| USD | 200,000                    | OCCIDENTAL PETE 6.6250% 01/09/30    | 200,000 | 240,000 | 0.05     |
| USD | 225,000                    | LEGACY LIFEPO 6.7500% 15/04/25 144A | 225,298 | 239,344 | 0.05     |
| USD | 240,000                    | OCCIDENTAL PETE 3.5000% 15/08/29    | 172,761 | 237,600 | 0.05     |
| USD | 225,000                    | TARGA RES PRTRNS 5.0000% 15/01/28   | 229,625 | 237,375 | 0.04     |
| USD | 237,000                    | QUICKEN LOANS 3.8750% 01/03/31 144A | 237,000 | 237,346 | 0.04     |
| USD | 225,000                    | NGL EN OP/FIN 7.5000% 01/02/26 144A | 225,000 | 236,250 | 0.04     |
| USD | 225,000                    | SONIC AUTOMOTIVE 6.1250% 15/03/27   | 225,000 | 235,969 | 0.04     |
| USD | 225,000                    | REALOGY GRP / 5.7500% 15/01/29 144A | 227,250 | 235,125 | 0.04     |
| USD | 225,000                    | UNITED CONT HLDG 4.8750% 15/01/25   | 202,031 | 233,438 | 0.04     |
| USD | 219,000                    | APACHE CORP 4.3750% 15/10/28        | 197,803 | 233,235 | 0.04     |
| USD | 225,000                    | WEEKLEY HM LL 4.8750% 15/09/28 144A | 226,250 | 232,875 | 0.04     |
| USD | 225,000                    | NCR CORP 5.1250% 15/04/29 144A      | 225,063 | 232,031 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | FORTRESS TRAN 9.7500% 01/08/27 144A | 202,423 | 231,250 | 0.04     |
| USD | 220,000                    | CINEMARK USA 5.8750% 15/03/26 144A  | 220,000 | 230,219 | 0.04     |
| USD | 225,000                    | PLASTIPAK HOL 6.2500% 15/10/25 144A | 203,438 | 230,063 | 0.04     |
| USD | 225,000                    | UNIVISION COMM 5.125% 15/02/25 144A | 219,375 | 229,545 | 0.04     |
| USD | 225,000                    | KEN GARFF AUT 4.8750% 15/09/28 144A | 225,406 | 229,500 | 0.04     |
| USD | 220,000                    | PIKE CORP 5.5000% 01/09/28 144A     | 220,813 | 228,800 | 0.04     |
| USD | 235,000                    | LEVEL 3 FIN I 3.7500% 15/07/29 144A | 232,244 | 228,314 | 0.04     |
| USD | 220,000                    | CLEAR CHANNEL 7.5000% 01/06/29 144A | 220,000 | 228,114 | 0.04     |
| USD | 220,000                    | WASTE PRO USA 5.5000% 15/02/26 144A | 218,813 | 226,600 | 0.04     |
| USD | 250,000                    | AHERN RENTALS 7.375% 15/5/23 144A   | 222,886 | 225,625 | 0.04     |
| USD | 215,000                    | POST HLDGS 5.75% 01/03/27 144A      | 199,370 | 224,944 | 0.04     |
| USD | 215,000                    | DISH DBS CORP 5% 15/03/23           | 204,225 | 224,675 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | VAREX IMAGING 7.8750% 15/10/27 144A | 205,688 | 224,000 | 0.04     |
| USD | 225,000                    | GRAY TELE INC 4.7500% 15/10/30 144A | 227,000 | 223,875 | 0.04     |
| USD | 215,000                    | AMN HEALTHCAR 4.6250% 01/10/27 144A | 210,744 | 223,331 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | WESCO DISTRIB 7.2500% 15/06/28 144A | 198,488 | 222,000 | 0.04     |
| USD | 225,000                    | CALLON PETROLEUM 6.1250% 01/10/24   | 222,625 | 221,803 | 0.04     |
| USD | 215,000                    | UNITED RENTAL NA 4.0000% 15/07/30   | 217,813 | 221,450 | 0.04     |
| USD | 215,000                    | SRS DISTRIBUT 6.1250% 01/07/29 144A | 217,650 | 221,259 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | FORD MOTOR CRED 5.1250% 16/06/25    | 200,000 | 220,250 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | UBER TECHNOLO 7.5000% 15/09/27 144A | 217,163 | 219,796 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | NCR CORP 6.1250% 01/09/29 144A      | 200,000 | 218,000 | 0.04     |
| USD | 210,000                    | PARK INTERMED 4.8750% 15/05/29 144A | 210,281 | 217,613 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | FIRSTENERGY CORP 4.4000% 15/07/27 B | 221,500 | 217,556 | 0.04     |
| USD | 215,000                    | EDGEWELL PERS 4.1250% 01/04/29 144A | 215,000 | 217,284 | 0.04     |
| USD | 225,000                    | PENNYMAC FIN 4.2500% 15/02/29 144A  | 223,875 | 216,767 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | PATRICK INDS 7.5000% 15/10/27 144A  | 200,000 | 216,750 | 0.04     |
| USD | 210,000                    | GENESIS ENERGY 7.7500% 01/02/28     | 158,150 | 216,300 | 0.04     |
| USD | 205,000                    | CHS/COMMUNITY 6.8750% 15/04/29 144A | 206,169 | 215,506 | 0.04     |
| USD | 205,000                    | MIDCONTINENT 5.3750% 15/08/27 144A  | 208,508 | 215,250 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | HERTZ CORP 6.0000% 15/01/28 144A    | 200,000 | 215,000 | 0.04     |
| USD | 175,000                    | NETFLIX INC 5.8750% 15/11/28        | 178,932 | 214,813 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | FORD MOTOR CRED 4.2710% 09/01/27    | 149,000 | 214,280 | 0.04     |
| EUR | 170,000                    | ENCORE CAPITA 4.8750% 15/10/25 REGS | 198,741 | 213,702 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | SPIRIT AEROSY 7.5000% 15/04/25 144A | 200,000 | 213,500 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | AFFINITY GAMI 6.8750% 15/12/27 144A | 209,750 | 212,250 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | CENTURY COMMUNIT 6.7500% 01/06/27   | 207,500 | 212,250 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | SRM ESCROW IS 6.0000% 01/11/28 144A | 200,875 | 211,750 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | PGT INNOVATIO 6.7500% 01/08/26 144A | 202,969 | 211,115 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | TRANSDIGM INC 6.2500% 15/03/26 144A | 205,026 | 211,000 | 0.04     |
| USD | 205,000                    | TARGA RES PRT 4.0000% 15/01/32 144A | 205,000 | 210,894 | 0.04     |
| USD | 215,000                    | OLYMPUS MERGE 8.5000% 15/10/25 144A | 201,019 | 210,163 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | P&L DEV/PLD F 7.7500% 15/11/25 144A | 203,844 | 210,000 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | CNX MID PART/ 6.5000% 15/03/26 144A | 192,000 | 209,800 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | CLEARWAY ENER 4.7500% 15/03/28 144A | 200,000 | 209,750 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | HESS MIDSTREA 5.1250% 15/06/28 144A | 200,000 | 209,750 | 0.04     |
| USD | 195,000                    | SCIENTIFIC GA 8.2500% 15/03/26 144A | 202,076 | 209,134 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | CHOBANI LLC/FIN 7.5% 15/04/25 144A  | 200,000 | 208,082 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | VICI PROPERTI 4.2500% 01/12/26 144A | 202,700 | 208,044 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | REAL HERO MER 6.2500% 01/02/29 144A | 204,919 | 208,000 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | HUB INTL LTD 7.0000% 01/05/26 144A  | 207,000 | 207,418 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | LSF9 ATL/VIC 7.7500% 15/02/26 144A  | 203,250 | 207,412 | 0.04     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨  | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価    | 評価金額    | 純資産比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|---------|----------|
| USD | 200,000                    | FORD MOTOR CRED 3.3750% 13/11/25    | 200,000 | 207,250 | 0.04     |
| USD | 175,000                    | NETFLIX INC 4.8750% 15/06/30 144A   | 206,938 | 207,156 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | SASOL FINANCING 4.3750% 18/09/26    | 205,400 | 206,600 | 0.04     |
| USD | 205,000                    | NORTHWEST FIB 6.0000% 15/02/28 144A | 207,800 | 205,449 | 0.04     |
| USD | 190,000                    | PRIME HEALTHC 7.2500% 01/11/25 144A | 196,525 | 204,725 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | HILTON GRAND 5.0000% 01/06/29 144A  | 200,000 | 204,500 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | SM ENERGY CO 6.6250% 15/01/27       | 174,500 | 204,500 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | KRATON POLYME 4.2500% 15/12/25 144A | 202,400 | 204,000 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | ORGANON FIN 1 4.1250% 30/04/28 144A | 200,000 | 204,000 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | FORD MOTOR CRED 3.6250% 17/06/31    | 200,000 | 203,500 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | SUMMER (BC) B 5.5000% 31/10/26 144A | 203,500 | 203,410 | 0.04     |
| USD | 195,000                    | COMPASS GRP L 5.2500% 15/04/29 144A | 195,875 | 203,338 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | GROUP 1 AUTO 4.0000% 15/08/28 144A  | 202,063 | 203,080 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | BRISTOW GROUP 6.8750% 01/03/28 144A | 201,500 | 203,000 | 0.04     |
| USD | 190,000                    | HCA INC 3.5000% 01/09/30            | 197,125 | 202,094 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | MPT OP PTNR/FINL 3.5000% 15/03/31   | 201,875 | 201,500 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | CSC HOLDINGS 4.5000% 15/11/31 144A  | 200,000 | 201,250 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | TTM TECHNOLOG 4.0000% 01/03/29 144A | 200,119 | 201,182 | 0.04     |
| USD | 200,000                    | ATLAS LUXCO 4 4.6250% 01/06/28 144A | 200,000 | 200,768 | 0.04     |
| USD | 185,000                    | ALBERTSONS CO 5.8750% 15/02/28 144A | 181,920 | 198,875 | 0.04     |
| USD | 215,000                    | AMERICAN AIR 3.7500% 01/03/25 144A  | 170,500 | 198,069 | 0.04     |
| USD | 195,000                    | SIRIUS XM RAD 4.1250% 01/07/30 144A | 195,000 | 197,438 | 0.04     |
| USD | 190,000                    | XHR LP 4.8750% 01/06/29 144A        | 192,333 | 196,175 | 0.04     |
| USD | 160,000                    | SPRINT CORP 7.6250% 01/03/26        | 198,706 | 195,781 | 0.04     |
| USD | 185,000                    | COMMSCOPE FIN 6.0000% 01/03/26 144A | 186,307 | 195,377 | 0.04     |
| USD | 175,000                    | OCCIDENTAL PETE 5.8750% 01/09/25    | 175,000 | 195,064 | 0.04     |
| USD | 186,000                    | JACOBS ENTERT 7.8750% 01/02/24 144A | 188,186 | 194,370 | 0.04     |
| USD | 175,000                    | NAVIENT CORP 6.7500% 15/06/26       | 191,406 | 194,250 | 0.04     |
| USD | 195,000                    | PRIME SEC/FIN 3.3750% 31/08/27 144A | 195,000 | 189,638 | 0.04     |
| USD | 170,000                    | EQM MIDSTREAM 6.5000% 01/07/27 144A | 170,000 | 189,550 | 0.04     |
| USD | 180,000                    | BANFF MERGER 9.7500% 01/09/26 144A  | 177,881 | 189,450 | 0.04     |
| USD | 180,000                    | TENET HEALTHC 6.2500% 01/02/27 144A | 182,409 | 188,100 | 0.04     |
| USD | 170,000                    | NAVIENT CORP 7.25% 25/09/23         | 166,846 | 187,850 | 0.04     |
| USD | 190,000                    | PAYSAFE FIN P 4.0000% 15/06/29 144A | 188,269 | 187,625 | 0.04     |
| USD | 175,000                    | QTS LP/FINANC 3.8750% 01/10/28 144A | 176,944 | 186,979 | 0.04     |
| USD | 175,000                    | SELECT MEDICA 6.2500% 15/08/26 144A | 181,174 | 186,379 | 0.04     |
| USD | 175,000                    | ASHTON WOODS 6.6250% 15/01/28 144A  | 175,169 | 186,375 | 0.04     |
| USD | 180,000                    | NATIONSTAR MT 6.0000% 15/01/27 144A | 179,881 | 186,300 | 0.04     |
| USD | 175,000                    | TRANSDIGM INC 7.5000% 15/03/27 WI   | 175,000 | 186,156 | 0.04     |
| USD | 175,000                    | GOLDEN ENTERT 7.6250% 15/04/26 144A | 175,000 | 185,938 | 0.04     |
| USD | 175,000                    | MGM RESORTS 4.7500% 15/10/28        | 175,000 | 185,938 | 0.04     |
| USD | 165,000                    | OCCIDENTAL PETE 6.9500% 01/07/24    | 120,824 | 185,869 | 0.04     |
| USD | 225,000                    | GEO GROUP INC 6% 15/04/26           | 225,000 | 184,698 | 0.04     |
| USD | 176,000                    | USA PART/USA FI 6.8750% 01/04/26 WI | 145,183 | 184,360 | 0.03     |
| USD | 155,000                    | OCCIDENTAL PETE 6.4500% 15/09/36    | 73,125  | 183,928 | 0.03     |
| USD | 175,000                    | CLEVELAND-CLIFF 5.8750% 01/06/27 WI | 168,219 | 183,750 | 0.03     |
| USD | 175,000                    | MOHEGAN TRIBAL 7.875% 15/10/24 144A | 176,341 | 183,313 | 0.03     |
| USD | 175,000                    | GRAHAM HOLDIN 5.7500% 01/06/26 144A | 175,000 | 182,000 | 0.03     |
| USD | 175,000                    | FORTRESS TRAN 6.5000% 01/10/25 144A | 173,188 | 181,781 | 0.03     |
| USD | 175,000                    | LIFE TIME INC 5.7500% 15/01/26 144A | 175,000 | 181,563 | 0.03     |
| USD | 175,000                    | MERITAGE HOME 3.8750% 15/04/29 144A | 178,750 | 180,906 | 0.03     |
| USD | 175,000                    | J2 GLOBAL 4.6250% 15/10/30 144A     | 175,000 | 180,688 | 0.03     |
| USD | 170,000                    | ENCOMPASS HLTH 4.7500% 01/02/30     | 167,939 | 180,625 | 0.03     |
| USD | 175,000                    | ARCHES BUYER 6.1250% 01/12/28 144A  | 179,500 | 180,250 | 0.03     |
| USD | 170,000                    | VICI PROPERTI 4.6250% 01/12/29 144A | 173,215 | 180,200 | 0.03     |
| USD | 175,000                    | MATTHEWS INTE 5.2500% 01/12/25 144A | 175,000 | 180,031 | 0.03     |
| USD | 170,000                    | ADVANTAGE SAL 6.5000% 15/11/28 144A | 174,557 | 178,925 | 0.03     |
| USD | 170,000                    | AVANTOR FUNDI 4.6250% 15/07/28 144A | 178,550 | 178,670 | 0.03     |
| USD | 175,000                    | IRON MOUNTAIN 4.5000% 15/02/31 144A | 175,000 | 177,188 | 0.03     |
| USD | 175,000                    | AMN HEALTHCAR 4.0000% 15/04/29 144A | 176,000 | 177,139 | 0.03     |
| USD | 175,000                    | TRONOX INC 4.6250% 15/03/29 144A    | 175,000 | 176,965 | 0.03     |
| USD | 175,000                    | CEDAR FAIR/CANA 5.375% 01/06/24 WI  | 177,188 | 176,859 | 0.03     |
| USD | 175,000                    | PBF HOLDING C 9.2500% 15/05/25 144A | 179,125 | 176,750 | 0.03     |
| USD | 174,000                    | KRONOS ACQ / 5.0000% 31/12/26 144A  | 179,100 | 176,610 | 0.03     |
| USD | 170,000                    | EVERI PAYMENT 7.5000% 15/12/25 144A | 170,338 | 176,467 | 0.03     |
| USD | 175,000                    | OUTFRONT MEDI 4.2500% 15/01/29 144A | 174,875 | 176,094 | 0.03     |
| USD | 165,000                    | ALBERTSONS CO 4.8750% 15/02/30 144A | 159,300 | 174,488 | 0.03     |
| USD | 170,000                    | RACKSPACE TEC 5.3750% 01/12/28 144A | 174,475 | 174,250 | 0.03     |
| USD | 170,000                    | ENERGIZER HLD 4.7500% 15/06/28 144A | 170,000 | 174,208 | 0.03     |
| USD | 160,000                    | EQM MIDSTREAM 6.0000% 01/07/25 144A | 160,000 | 173,844 | 0.03     |
| USD | 165,000                    | STARWOOD PROP 5.5000% 01/11/23 144A | 164,675 | 173,631 | 0.03     |
| USD | 165,000                    | BLUE RACER MI 6.6250% 15/07/26 144A | 165,563 | 172,425 | 0.03     |
| USD | 175,000                    | SUMMIT MID HDGS 5.5% 15/08/22       | 175,536 | 172,375 | 0.03     |
| USD | 160,000                    | TKC HOLDINGS 10.5000% 15/05/29 144A | 160,000 | 172,227 | 0.03     |
| USD | 170,000                    | PARK RIVER HO 6.7500% 01/08/29 144A | 170,475 | 172,125 | 0.03     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨  | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価    | 評価金額    | 純資産比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|---------|----------|
| USD | 169,000                    | TEMPUR SEALY 4.0000% 15/04/29 144A  | 169,000 | 170,685 | 0.03     |
| USD | 155,000                    | PRIME SEC/FIN 5.7500% 15/04/26 144A | 157,300 | 170,653 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | KRAFT HEINZ FOOD 4.2500% 01/03/31   | 150,000 | 170,648 | 0.03     |
| USD | 165,000                    | SCRIPPS ESCRO 5.8750% 15/07/27 144A | 158,988 | 170,363 | 0.03     |
| USD | 160,000                    | USA PART/USA FIN 6.8750% 01/09/27   | 167,250 | 169,728 | 0.03     |
| USD | 165,000                    | VM CONSOLIDAT 5.5000% 15/04/29 144A | 165,000 | 167,888 | 0.03     |
| USD | 160,000                    | UNITED AIRLIN 4.3750% 15/04/26 144A | 160,000 | 166,338 | 0.03     |
| USD | 160,000                    | OUTFRONT MEDI 5.0000% 15/08/27 144A | 160,944 | 166,044 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | FREEMPORT-MCMORAN 5.2500% 01/09/29  | 166,125 | 165,563 | 0.03     |
| USD | 160,000                    | ICAHN ENTER/F 5.2500% 15/05/27 144A | 163,200 | 164,800 | 0.03     |
| USD | 155,000                    | GRIFFON CORP 5.7500% 01/03/28 WI    | 150,372 | 164,688 | 0.03     |
| USD | 165,000                    | CLEARWAY ENER 3.7500% 15/02/31 144A | 165,000 | 164,175 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | SCIENTIFIC GA 7.0000% 15/05/28 144A | 150,000 | 163,875 | 0.03     |
| USD | 175,000                    | COOPER STANDARD 5.625% 15/11/26     | 175,000 | 163,625 | 0.03     |
| USD | 160,000                    | BLOCK COMMUNI 4.8750% 01/03/28 144A | 154,925 | 163,200 | 0.03     |
| USD | 155,000                    | CCO HDG LLC/CAP 5.125% 01/05/27 144 | 158,100 | 162,713 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | PARK INTERMED 7.5000% 01/06/25 144A | 150,000 | 162,221 | 0.03     |
| USD | 160,000                    | ATKORE INC 4.2500% 01/06/31 144A    | 160,588 | 162,000 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | NORTHERN OIL 8.1250% 01/03/28 144A  | 150,000 | 161,625 | 0.03     |
| USD | 155,000                    | ANTERO MIDSTR 5.7500% 01/03/27 144A | 117,419 | 161,309 | 0.03     |
| USD | 155,000                    | ENLINK MIDSTREAM 4.1500% 01/06/25   | 142,375 | 161,006 | 0.03     |
| USD | 173,000                    | K HOVNANIAN 13.5000% 01/02/26 144A  | 212,243 | 160,890 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | HERTZ CORP 7.1250% 01/08/26 144A    | 150,000 | 160,875 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | COMMSCOPE FIN 8.2500% 01/03/27 144A | 143,668 | 160,313 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | OLIN CORP 5.0000% 01/02/30          | 148,375 | 160,209 | 0.03     |
| USD | 160,000                    | LADDER CAP FI 4.7500% 15/06/29 144A | 160,000 | 160,000 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | WESTERN GAS PART 5.3000% 01/03/48   | 118,625 | 159,375 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | SS&C TECH INC 5.5000% 30/09/27 144A | 150,000 | 159,347 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | ARCHROCK LP/F 6.8750% 01/04/27 144A | 150,000 | 159,188 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | TALOS PRODUCTI 12.0000% 15/01/26 WI | 139,500 | 159,000 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | AG ISSUER LLC 6.2500% 01/03/28 144A | 146,875 | 158,052 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | MURPHY OIL CORP 6.3750% 15/07/28    | 150,000 | 157,875 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | CLEVELAND-CLI 4.6250% 01/03/29 144A | 150,000 | 157,841 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | GO DADDY OP/F 5.2500% 01/12/27 144A | 150,638 | 157,500 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | CRESTWOOD MID 6.0000% 01/02/29 144A | 150,000 | 157,125 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | TITAN INTL IN 7.0000% 30/04/28 144A | 150,000 | 156,938 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | ASCENT RESOUR 7.0000% 01/11/26 144A | 128,250 | 156,932 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | TMS INTERNATI 6.2500% 15/04/29 144A | 152,250 | 156,750 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | CITGO PETROLE 6.3750% 15/06/26 144A | 150,000 | 156,515 | 0.03     |
| USD | 145,000                    | SPECTRUM BRAN 5.5000% 15/07/30 144A | 149,775 | 156,238 | 0.03     |
| USD | 145,000                    | CORNERSTONE 6.1250% 15/01/29 144A   | 150,256 | 155,513 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | BEAZER HOMES USA 6.7500% 15/03/25   | 150,000 | 154,875 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | BOYD GAMING CORP 4.7500% 01/12/27   | 152,883 | 154,875 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | MICHAELS COS 7.8750% 01/05/29 144A  | 150,000 | 154,875 | 0.03     |
| USD | 112,000                    | ASCENT RESOUR 9.0000% 01/11/27 144A | 89,988  | 154,800 | 0.03     |
| USD | 160,000                    | LEVEL 3 FIN I 3.6250% 15/01/29 144A | 160,000 | 154,400 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | T-MOBILE USA INC 4.5000% 01/02/26   | 150,000 | 153,896 | 0.03     |
| USD | 151,000                    | ARCOSA INC 4.3750% 15/04/29 144A    | 152,375 | 153,643 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | BCPE EMPIRE 7.6250% 01/05/27 144A   | 149,111 | 153,615 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | TENET HEALTHC 4.2500% 01/06/29 144A | 150,000 | 151,875 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | ALLIANT HOLDI 4.2500% 15/10/27 144A | 151,463 | 151,875 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | CALLON PETROL 8.0000% 01/08/28 144A | 150,000 | 151,313 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | HOSPITALITY PROP 4.3500% 01/10/24   | 139,656 | 151,050 | 0.03     |
| USD | 145,000                    | MAUSER PACKAG 8.5000% 15/04/24 144A | 145,024 | 150,075 | 0.03     |
| USD | 145,000                    | COVANTA HDGS CORP 5.875% 01/07/25   | 136,767 | 149,887 | 0.03     |
| USD | 140,000                    | WESTERN GAS PART 4.5000% 01/03/28   | 124,063 | 149,625 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | HILTON GRAND 4.8750% 01/07/31 144A  | 150,000 | 149,625 | 0.03     |
| USD | 140,000                    | LABL ESCROW I 6.7500% 15/07/26 144A | 141,356 | 149,342 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | HC2 HOLDINGS 8.5000% 01/02/26 144A  | 149,250 | 149,250 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | FERRELLGAS ES 5.3750% 01/04/26 144A | 150,000 | 148,688 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | FERRELLGAS ES 5.8750% 01/04/29 144A | 150,000 | 148,125 | 0.03     |
| USD | 300,000                    | DIAMOND SPORT 6.6250% 15/08/27 144A | 301,580 | 147,750 | 0.03     |
| USD | 135,000                    | TENET HEALTHC 7.5000% 01/04/25 144A | 135,000 | 145,818 | 0.03     |
| GBP | 100,000                    | ENCORE CAPITA 5.3750% 15/02/26 REGS | 149,402 | 145,749 | 0.03     |
| USD | 155,000                    | MACYS RETAIL HLD 4.5000% 15/12/34   | 146,088 | 145,700 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | LUMEN TECH IN 4.5000% 15/01/29 144A | 150,000 | 145,559 | 0.03     |
| GBP | 106,000                    | ATLAS LUXCO 4 4.8750% 01/06/28 REGS | 148,379 | 145,456 | 0.03     |
| USD | 140,000                    | UNITED AIRLIN 4.6250% 15/04/29 144A | 140,000 | 144,868 | 0.03     |
| USD | 133,000                    | TERRIER MEDIA 8.8750% 15/12/27 144A | 125,324 | 143,806 | 0.03     |
| USD | 140,000                    | VICI PROPERTI 4.1250% 15/08/30 144A | 144,794 | 143,755 | 0.03     |
| USD | 145,000                    | H&E EQUIPMENT 3.8750% 15/12/28 144A | 142,281 | 142,680 | 0.03     |
| USD | 125,000                    | WYNDHAM INC 6.6250% 31/07/26 144A   | 125,000 | 141,563 | 0.03     |
| USD | 135,000                    | APACHE CORP 5.1000% 01/09/40        | 116,373 | 141,216 | 0.03     |
| USD | 125,000                    | TAYLOR MORRIS 5.7500% 15/01/28 144A | 125,000 | 141,125 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | TPC GROUP IN 10.5000% 01/08/24 144A | 150,000 | 141,000 | 0.03     |

| 通貨  | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価    | 評価金額    | 純資産比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|---------|----------|
| USD | 125,000                    | RANGE RESOURC 8.2500% 15/01/29 144A | 126,125 | 140,938 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | OCCIDENTAL PETE 4.2000% 15/03/48    | 132,000 | 140,250 | 0.03     |
| USD | 125,000                    | AMERIGAS PART/FIN 5.75% 20/05/27    | 124,792 | 139,375 | 0.03     |
| USD | 125,000                    | NEW ENTERPRIS 9.7500% 15/07/28 144A | 131,188 | 139,375 | 0.03     |
| USD | 125,000                    | BEAZER HOMES USA 7.2500% 15/10/29   | 125,000 | 138,790 | 0.03     |
| USD | 125,000                    | OLIN CORP 5.6250% 01/08/29          | 124,980 | 138,304 | 0.03     |
| USD | 125,000                    | NAVIENT CORP 6.75% 25/06/25         | 130,844 | 138,281 | 0.03     |
| USD | 125,000                    | TARGA RES PRTRNS 5.5000% 01/03/30   | 125,000 | 137,458 | 0.03     |
| USD | 135,000                    | BWAY HDGS CO 5.5% 15/04/24 144A     | 121,448 | 136,350 | 0.03     |
| USD | 125,000                    | RADIAN GROUP INC 4.8750% 15/03/27   | 128,938 | 135,938 | 0.03     |
| USD | 125,000                    | AET UNI/AET F 8.2500% 15/02/26 144A | 125,000 | 135,781 | 0.03     |
| USD | 125,000                    | TARGA RES PRT 4.8750% 01/02/31 144A | 125,000 | 135,000 | 0.03     |
| USD | 125,000                    | MATCH GROUP I 5.6250% 15/02/29 144A | 126,875 | 135,000 | 0.03     |
| USD | 150,000                    | ENLINK MIDSTREAM 5.6000% 01/04/44   | 126,375 | 135,000 | 0.03     |
| USD | 125,000                    | COMPASS MIN I 6.7500% 01/12/27 144A | 125,000 | 134,219 | 0.03     |
| USD | 125,000                    | SEAWORLD PARK 9.5000% 01/08/25 144A | 125,000 | 134,063 | 0.03     |
| USD | 125,000                    | PRIME SEC/FIN 5.2500% 15/04/24 144A | 125,000 | 133,941 | 0.03     |
| USD | 125,000                    | MPT OP PTNR/FINL 4.6250% 01/08/29   | 120,417 | 133,808 | 0.03     |
| USD | 110,000                    | NEW ALBERTSONS INC 8% 01/05/31      | 108,028 | 133,100 | 0.03     |
| USD | 125,000                    | APX GROUP INC 6.7500% 15/02/27 144A | 125,933 | 133,084 | 0.03     |
| USD | 125,000                    | HILCORP ENERG 6.2500% 01/11/28 144A | 125,000 | 132,813 | 0.03     |
| USD | 125,000                    | PM GENERAL PU 9.5000% 01/10/28 144A | 125,000 | 131,678 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | CLEVELAND-CLI 4.8750% 01/03/31 144A | 125,000 | 131,250 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | ALLIANT HOLDI 6.7500% 15/10/27 144A | 129,722 | 131,245 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | BUILDERS FIRS 5.0000% 01/03/30 144A | 127,000 | 131,210 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | STANDARD INDS 4.7500% 15/01/28 144A | 122,454 | 130,838 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | ENVIVA PRTRNS 6.5000% 15/01/26 144A | 126,142 | 130,625 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | ALBERTSONS CO 4.6250% 15/01/27 144A | 126,250 | 130,599 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | SPECIALTY BUI 6.3750% 30/09/26 144A | 125,000 | 130,469 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | SUNOCO LP/FIN 6.0000% 15/04/27 WI   | 125,000 | 130,406 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | HESS MIDSTREA 5.6250% 15/02/26 144A | 125,000 | 130,375 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | TEREX CORP 5.0000% 15/05/29 144A    | 125,000 | 130,313 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | DOWNSTREAM D 10.5000% 15/02/23 144A | 125,067 | 130,294 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | EQT CORP 7.5000% 01/02/30           | 77,500  | 130,000 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | VERITAS US/BM 7.5000% 01/09/25 144A | 128,250 | 129,688 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | IRB HOLDING C 6.7500% 15/02/26 144A | 125,369 | 129,375 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | AVIS BUDGET C 4.7500% 01/04/28 144A | 125,000 | 128,325 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | SPRINT CAP CORP 6.875% 15/11/28     | 110,250 | 128,250 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | CENTENNIAL RE 6.8750% 01/04/27 144A | 108,325 | 127,826 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | COMSTOCK RE I 5.8750% 15/01/30 144A | 125,000 | 127,500 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | PG&E CORP 5.0000% 01/07/28          | 125,000 | 126,390 | 0.02     |
| USD | 129,543                    | DIG HOLD BM/I 8.0000% 31/12/26 REGS | 86,855  | 126,304 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | OXFORD FIN/COS 6.3750% 15/12/22     | 125,000 | 125,938 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | PG&E CORP 5.2500% 01/07/30          | 125,000 | 125,625 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | FREEDOM MORTG 6.6250% 15/01/27 144A | 125,000 | 125,408 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | SCIH SALT HOL 6.6250% 01/05/29 144A | 125,000 | 125,156 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | PLAYTIKA HOLD 4.2500% 15/03/29 144A | 125,000 | 125,000 | 0.02     |
| USD | 120,000                    | BRINK'S CO/TH 4.6250% 15/10/27 144A | 115,050 | 124,944 | 0.02     |
| USD | 120,000                    | EQM MIDSTREAM 4.7500% 15/01/31 144A | 120,000 | 123,653 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | ACRISURE LLC 4.2500% 15/02/29 144A  | 125,000 | 123,438 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | METIS MERGER 6.5000% 15/05/29 144A  | 125,000 | 123,281 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | HOSPITALITY PROP 4.9500% 01/10/29   | 112,438 | 123,110 | 0.02     |
| USD | 120,000                    | PDC ENERGY INC 6.1250% 15/09/24     | 123,357 | 122,724 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | SINCLAIR TELE 4.1250% 01/12/30 144A | 125,000 | 122,188 | 0.02     |
| EUR | 100,000                    | KRATON POLYME 5.2500% 15/05/26 REGS | 119,381 | 121,985 | 0.02     |
| USD | 172,000                    | K HOVNANIAN E 5.0000% 01/02/40 144A | 112,757 | 120,400 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | STANDARD INDS 3.3750% 15/01/31 144A | 125,000 | 119,375 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | HOSPITALITY PROP 4.3750% 15/02/30   | 116,875 | 119,063 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | KB HOME 6.8750% 15/06/27            | 99,813  | 119,000 | 0.02     |
| USD | 110,000                    | CHENIERE ENERGYP 4.5000% 01/10/29   | 110,000 | 118,250 | 0.02     |
| USD | 110,000                    | TOWNSQUARE ME 6.8750% 01/02/26 144A | 110,000 | 117,700 | 0.02     |
| USD | 115,000                    | SRS DISTRIBUT 4.6250% 01/07/28 144A | 115,000 | 117,588 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | L BRANDS INC 7.5000% 15/06/29       | 101,000 | 117,250 | 0.02     |
| USD | 125,000                    | SUMMIT MID HDGS 5.75% 15/04/25      | 125,000 | 114,688 | 0.02     |
| USD | 105,000                    | TARGA RES PRTRNS 6.5000% 15/07/27   | 105,656 | 114,206 | 0.02     |
| USD | 112,000                    | VIASAT INC 5.6250% 15/09/25 144A    | 110,600 | 113,781 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | SERVICE PROP 7.5000% 15/09/25       | 100,000 | 113,281 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | TENNECO INC 7.8750% 15/01/29 144A   | 100,000 | 112,443 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | RANGE RESOURCES 9.2500% 01/02/26 WI | 100,000 | 110,250 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | APACHE CORP 4.8750% 15/11/27        | 100,000 | 108,561 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | CNX RESOURCES 6.0000% 15/01/29 144A | 100,000 | 108,125 | 0.02     |
| USD | 106,000                    | CD&R WATERWOR 6.1250% 15/08/25 144A | 98,743  | 108,120 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | TRANSDIGM INC 8.0000% 15/12/25 144A | 100,000 | 108,001 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | WYNN RESORTS 7.7500% 15/04/25 144A  | 100,000 | 107,750 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | DISH DBS CORP 7.3750% 01/07/28      | 100,000 | 107,488 | 0.02     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンドーグローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨  | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価    | 評価金額    | 純資産比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|---------|----------|
| USD | 75,000                     | FORD MOTOR CO 9.6250% 22/04/30      | 75,000  | 107,433 | 0.02     |
| USD | 350,000                    | NWH ESCROW CORP 7.5% 01/08/21 144a  | 329,000 | 106,663 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | CHS/COMMUNITY 5.6250% 15/03/27 144A | 100,000 | 106,375 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | FRONTIER COMM 6.7500% 01/05/29 144A | 100,000 | 106,327 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | HILCORP ENER 6.0000% 01/02/31 144A  | 100,000 | 106,250 | 0.02     |
| USD | 95,000                     | ANTERO MIDSTR 7.8750% 15/05/26 144A | 95,000  | 106,087 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | POST HOLDINGS 5.6250% 15/01/28 144A | 99,547  | 106,000 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | TERRAFORM POW 5.0000% 31/01/28 144A | 100,000 | 105,875 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | NCR CORP 5.7500% 01/09/27 144A      | 100,000 | 105,813 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | FREEPORT-MCMORAN 4.3750% 01/08/28   | 100,000 | 105,625 | 0.02     |
| USD | 95,000                     | ANTERO RESOUR 7.6250% 01/02/29 144A | 95,000  | 105,450 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | ALLEGHENY TECH 5.8750% 01/12/27     | 90,000  | 104,750 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | ADAMS HOMES I 7.5000% 15/02/25 144A | 100,000 | 104,500 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | CENTENE CORP 3.3750% 15/02/30 WI    | 101,625 | 104,375 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | HILCORP ENER 5.7500% 01/02/29 144A  | 100,000 | 104,250 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | T-MOBILE USA INC 3.5000% 15/04/31   | 100,000 | 103,455 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | TENNECO INC 5.1250% 15/04/29 144A   | 100,000 | 102,875 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | NEW ENTERPRIS 6.2500% 15/03/26 144A | 100,000 | 102,750 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | SHEA HOMES 4.7500% 15/02/28 144A    | 100,000 | 102,750 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | LCM INVESTMEN 4.8750% 01/05/29 144A | 100,000 | 102,500 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | TRIUMPH GROUP 7.7500% 15/08/25      | 100,000 | 102,438 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | OCCIDENTAL PETE 2.9000% 15/08/24    | 72,000  | 102,250 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | CLAR SCI HLD 4.8750% 30/06/29 144A  | 100,000 | 102,250 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | ITT HOLDINGS 6.5000% 01/08/29 144A  | 100,000 | 102,125 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | CTR PARTNERSH 3.8750% 30/06/28 144A | 100,000 | 102,112 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | CENTURYTEL IN 4.0000% 15/02/27 144A | 100,000 | 102,020 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | SM ENERGY CO 6.75% 15/09/26         | 78,000  | 101,750 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | HARLAND CLARKE 8.375% 15/08/22 144A | 100,000 | 101,500 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | ASCEND LEARNI 6.8750% 01/08/25 144A | 100,000 | 101,394 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | CALPINE CORP 5.1250% 15/03/28 144A  | 103,000 | 101,000 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | HOSPITALITY PROP 5.2500% 15/02/26   | 91,500  | 100,750 | 0.02     |
| USD | 90,000                     | FORD MOTOR CO 5.2910% 08/12/46      | 86,350  | 100,404 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | ASCENT RESOUR 5.8750% 30/06/29 144A | 100,000 | 100,000 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | AMERICAN AIR 5.0000% 01/06/22 144A  | 75,964  | 100,000 | 0.02     |
| USD | 100,000                    | SCIH SALT HOL 4.8750% 01/05/28 144A | 100,000 | 99,988  | 0.02     |
| USD | 100,000                    | HOSPITALITY PROP 4.5000% 15/03/25   | 99,250  | 99,500  | 0.02     |
| USD | 100,000                    | MAJORDRIVE HO 6.3750% 01/06/29 144A | 100,000 | 99,375  | 0.02     |
| USD | 100,000                    | GO DADDY OP/F 3.5000% 01/03/29 144A | 100,000 | 98,875  | 0.02     |
| USD | 100,000                    | ALBERTSONS CO 3.5000% 15/03/29 144A | 99,000  | 98,875  | 0.02     |
| USD | 100,000                    | DISH DBS CORP 5.1250% 01/06/29 144A | 100,000 | 98,743  | 0.02     |
| USD | 90,000                     | AMER AXLE & MFG 6.8750% 01/07/28    | 93,344  | 98,738  | 0.02     |
| USD | 90,000                     | ORTHO-CLINICA 7.2500% 01/02/28 144A | 90,000  | 98,303  | 0.02     |
| USD | 95,000                     | SIRIUS XM RAD 4.0000% 15/07/28 144A | 95,000  | 97,889  | 0.02     |
| USD | 95,000                     | SURGERY CENTE 6.7500% 01/07/25 144A | 86,700  | 96,900  | 0.02     |
| USD | 150,000                    | EXELA INTER 10.0000% 15/07/23 144A  | 150,017 | 96,000  | 0.02     |
| USD | 100,000                    | DAVITA INC 3.7500% 15/02/31 144A    | 100,000 | 96,000  | 0.02     |
| USD | 95,000                     | NATIONSTAR MT 5.1250% 15/12/30 144A | 95,000  | 94,763  | 0.02     |
| USD | 90,000                     | GENESIS ENERGY 8.0000% 15/01/27     | 93,375  | 94,556  | 0.02     |
| USD | 75,000                     | KRAFT HEINZ FOOD 5.2000% 15/07/45   | 87,750  | 93,395  | 0.02     |
| USD | 85,000                     | BLUE RACER MI 7.6250% 15/12/25 144A | 85,000  | 92,234  | 0.02     |
| USD | 75,000                     | KRAFT HEINZ FOOD 5.0000% 15/07/35   | 82,178  | 92,045  | 0.02     |
| USD | 85,000                     | EQT MIDSTREAM PT 5.5000% 15/07/28   | 76,925  | 91,694  | 0.02     |
| USD | 90,000                     | ANTERO RESOUR 5.3750% 01/03/30 144A | 90,000  | 91,575  | 0.02     |
| USD | 90,000                     | POST HOLDINGS 4.6250% 15/04/30 144A | 94,950  | 91,350  | 0.02     |
| USD | 87,577                     | DIG HOLD BM/I 8.7500% 25/05/24 REGS | 102,794 | 91,190  | 0.02     |
| USD | 75,000                     | KRAFT HEINZ FOOD 4.8750% 01/10/49   | 76,428  | 90,548  | 0.02     |
| USD | 80,000                     | FORD MOTOR CO 8.5000% 21/04/23      | 80,000  | 89,113  | 0.02     |
| USD | 78,000                     | ANTERO RESOUR 8.3750% 15/07/26 144A | 78,975  | 88,530  | 0.02     |
| USD | 85,000                     | IRON MOUNTAIN 5.0000% 15/07/28 144A | 88,825  | 87,975  | 0.02     |
| USD | 80,000                     | SCIENTIFIC GA 8.6250% 01/07/25 144A | 83,850  | 87,600  | 0.02     |
| USD | 75,000                     | L BRANDS INC 6.6250% 01/10/30 144A  | 75,000  | 86,906  | 0.02     |
| USD | 85,000                     | UNITED RENTAL NA 3.8750% 15/02/31   | 85,000  | 86,488  | 0.02     |
| USD | 80,000                     | T-MOBILE USA INC 4.7500% 01/02/28   | 85,400  | 85,800  | 0.02     |
| USD | 85,000                     | T-MOBILE USA INC 2.2500% 15/02/26   | 85,425  | 85,638  | 0.02     |
| USD | 75,000                     | WESTERN GLBL 10.3750% 15/08/25 144A | 73,969  | 85,125  | 0.02     |
| USD | 85,000                     | ENERGIZER HLD 4.3750% 31/03/29 144A | 87,625  | 84,894  | 0.02     |
| USD | 80,000                     | OUTFRONT MEDI 6.2500% 15/06/25 144A | 84,000  | 84,563  | 0.02     |
| USD | 75,000                     | ACRISURE LLC 10.1250% 01/08/26 144A | 75,000  | 84,563  | 0.02     |
| USD | 80,000                     | CAESARS RESOR 5.7500% 01/07/25 144A | 80,000  | 84,300  | 0.02     |
| USD | 75,000                     | WESTERN MIDSTRM 5.3000% 01/02/30    | 63,656  | 83,906  | 0.02     |
| USD | 75,000                     | SPRINGLEAF FIN 8.8750% 01/06/25     | 75,000  | 83,152  | 0.02     |
| USD | 75,000                     | OCCIDENTAL PETE 5.5500% 15/03/26    | 52,813  | 83,003  | 0.02     |
| USD | 85,000                     | LIFEPOINT HEA 5.3750% 15/01/29 144A | 85,000  | 82,875  | 0.02     |
| USD | 75,000                     | UNIVISION COM 9.5000% 01/05/25 144A | 74,270  | 82,688  | 0.02     |
| USD | 75,000                     | GENWORTH MTGE 6.5000% 15/08/25 144A | 75,000  | 82,652  | 0.02     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨  | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                  | 取得時価   | 評価金額   | 純資産比率(%) |
|-----|----------------------------|--------------------------------------|--------|--------|----------|
| USD | 75,000                     | ASCENT RESOUR 8.2500% 31/12/28 144A  | 75,000 | 82,500 | 0.02     |
| USD | 80,000                     | COMMSCOPE TECH FIN 5% 15/03/27 144A  | 79,700 | 81,900 | 0.02     |
| USD | 75,000                     | HILTON DOMEST 5.7500% 01/05/28 144A  | 75,000 | 80,993 | 0.02     |
| USD | 75,000                     | IRB HOLDING C 7.0000% 15/06/25 144A  | 75,000 | 80,859 | 0.02     |
| USD | 75,000                     | CEDAR FAIR LP 6.5000% 01/10/28 144A  | 75,000 | 80,813 | 0.02     |
| USD | 75,000                     | CLEVELAND-CLI 6.7500% 15/03/26 144A  | 74,087 | 80,769 | 0.02     |
| USD | 75,000                     | BRIGHTSTAR ES 9.7500% 15/10/25 144A  | 75,000 | 80,719 | 0.02     |
| USD | 75,000                     | RADIAN GROUP INC 4.5000% 01/10/24    | 75,000 | 80,327 | 0.02     |
| USD | 75,000                     | BOXER PARENT 7.1250% 02/10/25 144A   | 75,000 | 80,250 | 0.02     |
| USD | 75,000                     | ENDEAVOR ENER 5.7500% 30/01/28 144A  | 78,000 | 80,022 | 0.02     |
| USD | 75,000                     | SOLARIS MIDST 7.6250% 01/04/26 144A  | 75,000 | 79,500 | 0.02     |
| USD | 70,000                     | TAYLOR MORRIS 5.8750% 15/06/27 144A  | 70,000 | 79,188 | 0.02     |
| USD | 73,000                     | ORTHO-CLINICA 7.3750% 01/06/25 144A  | 73,000 | 78,384 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | GOODYEAR TIRE 5.2500% 15/07/31 144A  | 75,000 | 78,258 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | GOODYEAR TIRE 5.0000% 15/07/29 144A  | 75,000 | 78,188 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | AVIS BUDGET C 5.3750% 01/03/29 144A  | 75,000 | 78,094 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | LITHIA MOTORS 3.8750% 01/06/29 144A  | 75,000 | 77,719 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | COLGATE ENERG 5.8750% 01/07/29 144A  | 75,000 | 77,625 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | FORESTAR GROU 5.0000% 01/03/28 144A  | 75,000 | 77,625 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | T-MOBILE USA 3.5000% 15/04/31 144A   | 75,750 | 77,591 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | T-MOBILE USA INC 3.3750% 15/04/29    | 75,000 | 77,588 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | T-MOBILE USA 3.3750% 15/04/29 144A   | 75,750 | 77,588 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | NCR CORP 5.0000% 01/10/28 144A       | 75,000 | 77,555 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | RANGE RESOURCES 5.0000% 15/03/23     | 67,688 | 77,500 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | CEDAR FAIR LP 5.2500% 15/07/29       | 75,000 | 77,351 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | SHEA HOMES 4.7500% 01/04/29 144A     | 75,000 | 77,016 | 0.01     |
| USD | 70,000                     | KRAFT HEINZ FOOD 3.8750% 15/05/27    | 70,000 | 76,750 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | APACHE CORP 4.7500% 15/04/43         | 75,000 | 76,313 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | EQM MIDSTREAM 4.5000% 15/01/29 144A  | 75,000 | 76,219 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | TRIUMPH GROUP 6.2500% 15/09/24 144A  | 75,000 | 76,125 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | LUMEN TECH IN 5.3750% 15/06/29 144A  | 75,000 | 75,892 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | SPANISH BROAD 9.7500% 01/03/26 144A  | 75,000 | 75,750 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | FORESTAR GROU 3.8500% 15/05/26 144A  | 75,000 | 75,679 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | KB HOME 4.0000% 15/06/31             | 75,000 | 75,656 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | LIFEPPOINT HEA 4.3750% 15/02/27 144A | 75,000 | 75,563 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | UNIVISION COM 4.5000% 01/05/29 144A  | 75,000 | 75,563 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | HAT HOLDINGS 3.3750% 15/06/26 144A   | 75,000 | 75,516 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | CLAR SCI HLD 3.8750% 30/06/28 144A   | 75,000 | 75,380 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | TRANSDIGM INC 4.6250% 15/01/29 144A  | 75,000 | 75,026 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | VICTORS MERGE 6.3750% 15/05/29 144A  | 75,000 | 75,000 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | MICROSTRATEGY 6.1250% 15/06/28 144A  | 75,000 | 74,813 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | BEACON ROOFIN 4.1250% 15/05/29 144A  | 75,000 | 74,808 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | PATRICK INDS 4.7500% 01/05/29 144A   | 75,000 | 74,719 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | API GROUP DE 4.1250% 15/07/29 144A   | 75,000 | 74,625 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | ICAHN ENTER/F 4.3750% 01/02/29 144A  | 75,000 | 74,250 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | FOUNDATION BL 6.0000% 01/03/29 144A  | 75,375 | 74,063 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | APLLO CMR RE 4.6250% 15/06/29 144A   | 75,000 | 73,969 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | CALPINE CORP 4.6250% 01/02/29 144A   | 75,000 | 73,736 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | NRG ENERGY IN 3.3750% 15/02/29 144A  | 75,000 | 73,408 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | SBA COMMUNICA 3.1250% 01/02/29 144A  | 75,000 | 72,316 | 0.01     |
| USD | 70,000                     | FS ENERGY & P 7.5000% 15/08/23 REGS  | 68,581 | 72,275 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | CALLON PETROLEU 6.3750% 01/07/26 WI  | 75,000 | 71,813 | 0.01     |
| USD | 65,956                     | GULFPORT ENER 8.0000% 17/05/26 144A  | 59,859 | 70,256 | 0.01     |
| USD | 100,000                    | ENVISION HEAL 8.7500% 15/10/26 144A  | 99,097 | 70,000 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | TALEN ENERGY 6.6250% 15/01/28 144A   | 75,000 | 68,250 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | ENLINK MIDSTREAM 5.05% 01/04/45      | 62,438 | 64,500 | 0.01     |
| USD | 65,000                     | SENSATA TECHN 3.7500% 15/02/31 144A  | 65,000 | 64,350 | 0.01     |
| USD | 55,000                     | KRAFT HEINZ FOOD 4.3750% 01/06/46    | 56,375 | 62,295 | 0.01     |
| USD | 55,000                     | SURGERY CENT 10.0000% 15/04/27 144A  | 52,938 | 60,363 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | OCCIDENTAL PETE 8.0000% 15/07/25     | 50,000 | 59,750 | 0.01     |
| USD | 60,000                     | NATIONAL CINE 5.8750% 15/04/28 144A  | 57,750 | 58,950 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | DELTA AIR LINES 7.3750% 15/01/26     | 49,993 | 58,698 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | DELTA AIR LIN 7.0000% 01/05/25 144A  | 50,000 | 58,434 | 0.01     |
| USD | 55,000                     | QUICKEN LOANS 5.2500% 15/01/28 144A  | 58,506 | 57,750 | 0.01     |
| USD | 55,000                     | APACHE CORP 4.2500% 15/01/30         | 50,057 | 57,750 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | CENTURYLINK INC 7.5% 01/04/24 Y      | 49,625 | 56,125 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | TRI POINTE GROUP 5.7000% 15/06/28    | 50,000 | 55,125 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | FULL HOUSE RE 8.2500% 15/02/28 144A  | 50,000 | 54,500 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | TALEN ENERGY 10.5000% 15/01/26 144A  | 73,496 | 54,375 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | KB HOME 4.8000% 15/11/29             | 52,563 | 54,174 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | DELUXE CORP 8.0000% 01/06/29 144A    | 50,000 | 53,875 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | FRONTIER COMM 5.8750% 15/10/27 144A  | 50,000 | 53,589 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | SERVICE PROP 5.5000% 15/12/27        | 50,000 | 53,406 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | PARTY CITY HL 8.7500% 15/02/26 144A  | 50,000 | 53,375 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | SPIRIT AEROSY 5.5000% 15/01/25 144A  | 50,000 | 53,125 | 0.01     |

ノムラ・マルチ・マネージャーズ・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・ボンド

| 通貨  | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価    | 評価金額   | 純資産比率(%) |
|-----|----------------------------|-------------------------------------|---------|--------|----------|
| USD | 50,000                     | NEXSTAR ESCRO 5.6250% 15/07/27 144A | 50,871  | 53,000 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | GOLDEN NUGGET 8.7500% 01/10/25 144A | 50,979  | 52,756 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | LAMAR MEDIA CORP 4.8750% 15/01/29   | 50,000  | 52,750 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | NEXTERA ENERG 4.2500% 15/07/24 144A | 50,000  | 52,750 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | HAT HOLDINGS 6.0000% 15/04/25 144A  | 50,000  | 52,706 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | EQT CORP 3.6250% 15/05/31 144A      | 50,000  | 52,375 | 0.01     |
| USD | 51,000                     | PAR PHARMA IN 7.5000% 01/04/27 144A | 45,938  | 52,170 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | FORTRESS TRAN 5.5000% 01/05/28 144A | 50,000  | 52,063 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | MATTEL INC 3.7500% 01/04/29 144A    | 50,000  | 52,000 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | MATTEL INC 3.3750% 01/04/26 144A    | 50,000  | 51,931 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | NRG ENERGY INC 7.25% 15/05/26       | 52,431  | 51,830 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | FXI HOLDINGS 7.8750% 01/11/24 144A  | 51,750  | 51,563 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | SM ENERGY CO 6.5000% 15/07/28       | 50,000  | 51,375 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | PBF HOLDING CO 6.0000% 15/02/28     | 55,406  | 51,375 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | EQT MIDSTREAM PARTNERS 4% 01/08/24  | 49,750  | 51,353 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | SWITCH LTD 4.1250% 15/06/29 144A    | 50,000  | 51,313 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | MICHAELS COS 5.2500% 01/05/28 144A  | 50,000  | 51,297 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | EQT CORP 3.1250% 15/05/26 144A      | 50,000  | 51,148 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | JBS USA/FOOD/ 3.7500% 01/12/31 144A | 50,000  | 51,063 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | SUNOCO LP/FIN 4.5000% 15/05/29 144A | 50,000  | 51,000 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | VICI PROPERTI 3.7500% 15/02/27 144A | 50,000  | 50,938 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | LAMAR MEDIA CORP 3.7500% 15/02/28   | 50,000  | 50,875 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | MADISON IAQ L 5.8750% 30/06/29 144A | 50,000  | 50,875 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | LEEWARD RENEW 4.2500% 01/07/29 144A | 50,000  | 50,813 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | OUTFRONT MEDI 4.6250% 15/03/30 144A | 50,000  | 50,750 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | AHP HEALTH 5.7500% 15/07/29 144A    | 50,000  | 50,625 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | ENTEGRIS INC 3.6250% 01/05/29 144A  | 50,000  | 50,625 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | AMBIENCE MERG 7.1250% 15/07/29 144A | 50,000  | 50,500 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | MADISON IAQ L 4.1250% 30/06/28 144A | 50,000  | 50,469 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | HILTON DOMEST 3.7500% 01/05/29 144A | 50,000  | 50,385 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | ASSUREDPARTNE 5.6250% 15/01/29 144A | 50,000  | 50,000 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | PENN NATL GAM 4.1250% 01/07/29 144A | 50,000  | 50,000 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | CARROLS RESTA 5.8750% 01/07/29 144A | 50,000  | 49,625 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | ARCHES BUYER 4.2500% 01/06/28 144A  | 50,000  | 49,313 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | LAMAR MEDIA C 3.6250% 15/01/31 144A | 50,000  | 48,875 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | SPIRIT AEROSYS 4.6000% 15/06/28     | 48,250  | 48,813 | 0.01     |
| USD | 50,000                     | 99 ESCROW ISS 7.5000% 15/01/26 144A | 50,000  | 48,750 | 0.01     |
| USD | 45,000                     | CONTINENTAL RES 4.5% 15/04/23       | 39,098  | 47,025 | 0.01     |
| USD | 42,000                     | TRIUMPH GROUP 8.8750% 01/06/24 144A | 42,000  | 46,725 | 0.01     |
| USD | 40,000                     | AMC ENTMNT H 10.5000% 15/04/25 144A | 43,700  | 43,550 | 0.01     |
| USD | 40,000                     | VIASAT INC 6.5000% 15/07/28 144A    | 41,169  | 42,617 | 0.01     |
| USD | 75,000                     | NINE ENERGY S 8.7500% 01/11/23 144A | 75,000  | 38,250 | 0.01     |
| USD | 35,000                     | GTCR AP FINAN 8.0000% 15/05/27 144A | 32,113  | 37,275 | 0.01     |
| USD | 25,000                     | L BRANDS INC 9.3750% 01/07/25 144A  | 25,000  | 32,313 | 0.01     |
| USD | 30,000                     | LIONS GATE CA 5.5000% 15/04/29 144A | 30,600  | 31,538 | 0.01     |
| USD | 25,000                     | OLIN CORP 9.5000% 01/06/25 144A     | 24,875  | 31,125 | 0.01     |
| USD | 25,000                     | OCCIDENTAL PETE 6.2000% 15/03/40    | 15,813  | 28,268 | 0.01     |
| USD | 25,000                     | RADIAN GROUP INC 6.6250% 15/03/25   | 25,000  | 28,241 | 0.01     |
| USD | 25,000                     | DIEBOLD NIXDO 9.3750% 15/07/25 144A | 24,758  | 27,618 | 0.01     |
| USD | 25,000                     | ENDEAVOR ENER 6.6250% 15/07/25 144A | 25,000  | 26,750 | 0.01     |
| USD | 25,000                     | CLIFFS NATURAL R 6.2500% 01/10/40   | 19,625  | 26,375 | 0.00     |
| USD | 25,000                     | PACIFIC GAS&ELEC 3.4500% 01/07/25   | 22,026  | 26,219 | 0.00     |
| USD | 25,000                     | PACIFIC GAS&ELEC 3.7500% 01/07/28   | 22,395  | 26,200 | 0.00     |
| USD | 25,000                     | UNITED CONTINENTAL 5% 01/02/24      | 17,375  | 25,938 | 0.00     |
| USD | 25,000                     | MATCH GROUP I 4.6250% 01/06/28 144A | 25,000  | 25,906 | 0.00     |
| USD | 24,000                     | ENCOMPASS HLTH 4.6250% 01/04/31     | 24,000  | 25,715 | 0.00     |
| USD | 25,000                     | UNITED CONT HLDG 4.2500% 01/10/22   | 21,719  | 25,660 | 0.00     |
| USD | 25,000                     | KAISER ALUMIN 4.5000% 01/06/31 144A | 25,438  | 25,639 | 0.00     |
| USD | 25,000                     | NFP CORP 4.8750% 15/08/28           | 25,000  | 25,438 | 0.00     |
| USD | 25,000                     | AMBIENCE MERG 4.8750% 15/07/28 144A | 25,000  | 25,094 | 0.00     |
| USD | 25,000                     | TALEN ENERGY 7.6250% 01/06/28 144A  | 25,000  | 23,438 | 0.00     |
| USD | 25,000                     | ENLINK MIDSTREAM 5.4500% 01/06/47   | 21,625  | 22,250 | 0.00     |
| USD | 20,000                     | LAREDO PETROLEUM 10.1250% 15/01/28  | 7,300   | 21,970 | 0.00     |
| USD | 20,000                     | GENESIS ENERGY 6.5000% 01/10/25     | 19,250  | 20,175 | 0.00     |
| USD | 779,000                    | SANCHEZ ENERGY ESC 0.0000% 15/01/23 | 643,742 | 15,580 | 0.00     |
| USD | 10,000                     | AMC ENTMNT H 10.5000% 24/04/26 144A | 9,496   | 10,863 | 0.00     |
| USD | 300,000                    | SANCHEZ ENERGY ESC 7.7500% 15/06/21 | 277,996 | 6,000  | 0.00     |
| USD | 475,000                    | CLOUD PEAK NRJ ESC 0.0000% 15/03/24 | 366,563 | 4,750  | 0.00     |
| USD | 75,000                     | GULFPORT NRG ESC 0.0000% 15/01/26   | 1,956   | 2,813  | 0.00     |
| USD | 75,000                     | GULFPORT NRG ESC 0.0000% 15/10/24   | 1,936   | 2,813  | 0.00     |
| USD | 75,000                     | GULFPORT NRG ESC 0.0000% 15/10/24   | 1,780   | 2,813  | 0.00     |
| USD | 50                         | IHEARTCOMMUNICAT 6.3750% 01/05/26   | 0       | 53     | 0.00     |
| USD | 1,000,000                  | HAWKER-REDM 9.7500% 01/04/17        | 597,500 | 0      | 0.00     |
| USD | 250,000                    | SEVENTY SEVEN ENER ESC 6.5% 15/7/22 | 0       | 0      | 0.00     |
| USD | 100,000                    | RRI ENERGY ESCROW 0.0000% 15/06/28  | 0       | 0      | 0.00     |

| 通貨                 | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価        | 評価金額        | 純資産比率(%) |
|--------------------|----------------------------|-------------------------------------|-------------|-------------|----------|
| USD                | 425,000                    | APPVION INC ESC 0.0000% 01/06/20    | 268,188     | 0           | 0.00     |
| USD                | 175,000                    | QUEBECO 9.125% 15/08/19 ESCROW      | 179,135     | 0           | 0.00     |
| USD                | 75,000                     | GENON ENERGY INC E 0.0000% 15/10/18 | 0           | 0           | 0.00     |
| USD                | 277                        | ENERGY FUTURE 11.2500% 01/11/17     | 112         | 0           | 0.00     |
|                    |                            |                                     | 139,939,012 | 144,595,074 | 27.40    |
| <b>優先証券</b>        |                            |                                     |             |             |          |
| —                  | 2,252                      | GMAC CAP TST I PFD FRN 15/02/40     | 55,204      | 57,426      | 0.01     |
| —                  | 177                        | NINE POINT ENERGY HOLDINGS PFD DUMM | 177,000     | 0           | 0.00     |
|                    |                            |                                     | 232,204     | 57,426      | 0.01     |
| <b>ワラント</b>        |                            |                                     |             |             |          |
| —                  | 1,176                      | IHEART WTS 01/05/39                 | 45,039      | 31,452      | 0.01     |
| —                  | 1,367                      | SANDRIDGE-A-CW22                    | 0           | 26          | 0.00     |
| —                  | 575                        | SANDRIDGE-B-CW22                    | 0           | 10          | 0.00     |
| —                  | 415                        | APPVION HLD TRANCHE B 13/06/23 WTS  | 0           | 0           | 0.00     |
| —                  | 415                        | APPVION HLD TRANCHE A 13/06/23 WTS  | 0           | 0           | 0.00     |
|                    |                            |                                     | 45,039      | 31,488      | 0.01     |
|                    |                            | 合計：アメリカ                             | 148,856,943 | 150,503,175 | 28.52    |
| <b>ウルグアイ</b>       |                            |                                     |             |             |          |
| <b>国債</b>          |                            |                                     |             |             |          |
| USD                | 172,462                    | URUGUAY 4.9750% 20/04/55            | 205,094     | 222,045     | 0.04     |
| USD                | 63,000                     | URUGUAY 7.8750% 15/01/33            | 88,251      | 94,815      | 0.02     |
|                    |                            |                                     | 293,345     | 316,860     | 0.06     |
| <b>その他債券</b>       |                            |                                     |             |             |          |
| USD                | 224,864                    | REP ORIENT URUGUAY 5.1% 18/06/50    | 245,255     | 294,853     | 0.06     |
| USD                | 36,000                     | REP ORIENT URUGUAY 7.625% 21/03/36  | 49,657      | 54,900      | 0.01     |
|                    |                            |                                     | 294,912     | 349,753     | 0.07     |
|                    |                            | 合計：ウルグアイ                            | 588,257     | 666,613     | 0.13     |
| <b>ウズベキスタン</b>     |                            |                                     |             |             |          |
| <b>国債</b>          |                            |                                     |             |             |          |
| USD                | 305,000                    | NATL BK OF UZBEK 4.8500% 21/10/25   | 305,000     | 319,683     | 0.06     |
|                    |                            |                                     | 305,000     | 319,683     | 0.06     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |             |             |          |
| USD                | 300,000                    | IPOTEKA-BANK ATI 5.5000% 19/11/25   | 300,000     | 311,625     | 0.06     |
|                    |                            |                                     | 300,000     | 311,625     | 0.06     |
|                    |                            | 合計：ウズベキスタン                          | 605,000     | 631,308     | 0.12     |
| <b>ベネズエラ</b>       |                            |                                     |             |             |          |
| <b>国債</b>          |                            |                                     |             |             |          |
| USD                | 1,227,100                  | REP OF VENEZUELA 9.25% 7/5/28       | 799,626     | 125,778     | 0.03     |
| USD                | 1,138,100                  | REP OF VENEZUELA 7.75% 13/10/19 REG | 510,347     | 116,655     | 0.02     |
| USD                | 768,000                    | VENEZUELA 9.2500% 15/09/27          | 428,961     | 79,872      | 0.02     |
| USD                | 684,400                    | REP OF VENEZUELA 9% 07/05/23        | 286,244     | 68,098      | 0.01     |
| USD                | 578,300                    | BOL REP OF VZLA 8.25% 13/10/24 REGS | 197,914     | 59,565      | 0.01     |
| USD                | 552,200                    | REP OF VENEZUELA 11.75% 21/10/26    | 266,176     | 57,429      | 0.01     |
|                    |                            |                                     | 2,489,268   | 507,397     | 0.10     |
| <b>その他債券</b>       |                            |                                     |             |             |          |
| USD                | 1,717,800                  | REP OF VENEZUELA 11.95% 5/8/31      | 683,583     | 177,792     | 0.03     |
| USD                | 3,730,000                  | PETROLEOS VENEZ 6% 16/05/24 REGS    | 757,938     | 158,525     | 0.03     |
| USD                | 638,000                    | PETROLEOS DE 8.5000% 27/10/20 REGS  | 194,293     | 81,345      | 0.02     |
| USD                | 1,780,000                  | PETROLEOS VENEZU 6% 15/11/26 REGS   | 539,825     | 75,650      | 0.01     |
| USD                | 421,400                    | BOL REP OF VZLA 12.75% 23/08/22     | 303,144     | 42,140      | 0.01     |
| USD                | 199,207                    | PETROLEOS VENEZ 9.75% 17/05/35 REGS | 109,688     | 8,466       | 0.00     |
| USD                | 192,678                    | PETROLEOS VENEZU 9% 17/11/21 REGS   | 76,010      | 8,285       | 0.00     |
| USD                | 155,000                    | PETROLEOS VENEZU 12.75% 17/02/22 RE | 163,243     | 6,645       | 0.00     |
|                    |                            |                                     | 2,827,724   | 558,848     | 0.10     |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                            |                                     |             |             |          |
| USD                | 705,000                    | PETROLEOS DE VEN 5.5% 12/04/37      | 214,254     | 29,963      | 0.01     |
|                    |                            |                                     | 214,254     | 29,963      | 0.01     |
|                    |                            | 合計：ベネズエラ                            | 5,531,246   | 1,096,208   | 0.21     |

| 通貨    | 数量/<br>額面価格 <sup>(1)</sup> | 銘柄名                                 | 取得時価        | 評価金額        | 純資産比率(%) |
|-------|----------------------------|-------------------------------------|-------------|-------------|----------|
| ザンビア  |                            |                                     |             |             |          |
| その他債券 |                            |                                     |             |             |          |
| USD   | 217,000                    | ZAMBIA REP OF 8.9700% 30/07/27 REGS | 212,724     | 136,710     | 0.03     |
|       |                            |                                     | 212,724     | 136,710     | 0.03     |
|       |                            | 合計：ザンビア                             | 212,724     | 136,710     | 0.03     |
|       |                            | 組入資産合計                              | 481,920,331 | 483,603,198 | 91.68    |

(1) 額面価格は発行通貨建て表示

## 財務書類に関する注記 2021年6月30日現在

(購入金額、売却金額、契約数、額面は通貨を欄左側に表示)

### 注記1－外国為替先渡し契約

2021年6月30日現在、ファンドは以下の未決済外国為替先渡し契約を有していた。外国為替先渡し契約は日本円クラス、資源国通貨クラス、及びアジア通貨クラスの投資目的とヘッジ目的で用いられた。

| 購入通貨 | 購入金額          | 売却通貨 | 売却金額           | 満期日        | 未実現損益(米ドル)  |
|------|---------------|------|----------------|------------|-------------|
| BRL  | 189,946,587   | USD  | 37,422,000     | 2021年8月3日  | 755,891     |
| BRL  | 126,675,429   | USD  | 24,942,000     | 2021年8月3日  | 518,845     |
| BRL  | 124,777,005   | USD  | 24,659,000     | 2021年8月3日  | 420,276     |
| BRL  | 124,726,454   | USD  | 24,659,000     | 2021年8月3日  | 410,116     |
| USD  | 137,597       | JPY  | 15,240,000     | 2021年7月15日 | (283)       |
| USD  | 137,613       | JPY  | 15,240,000     | 2021年7月30日 | (285)       |
| ZAR  | 939,245,538   | USD  | 65,241,575     | 2021年7月30日 | 234,042     |
| AUD  | 94,032,347    | USD  | 70,580,793     | 2021年7月30日 | 113,338     |
| USD  | 575,347       | BRL  | 2,833,492      | 2021年8月3日  | 5,836       |
| USD  | 287,673       | AUD  | 378,784        | 2021年7月15日 | 2,922       |
| USD  | 287,673       | AUD  | 378,760        | 2021年7月30日 | 2,919       |
| USD  | 287,673       | ZAR  | 4,085,516      | 2021年7月30日 | 2,869       |
| USD  | 287,673       | ZAR  | 4,077,906      | 2021年7月15日 | 2,814       |
| JPY  | 4,147,822,313 | USD  | 37,570,844     | 2021年7月30日 | (39,508)    |
| BRL  | 97,372,927    | USD  | 19,672,888     | 2021年8月3日  | (101,634)   |
| JPY  | 3,243,857,795 | USD  | 29,638,243     | 2021年7月15日 | (290,201)   |
| AUD  | 66,101,537    | USD  | 51,225,201     | 2021年7月15日 | (1,533,155) |
| ZAR  | 709,313,624   | USD  | 52,076,243     | 2021年7月15日 | (2,527,487) |
| USD  | 44,400,175    | EUR  | 36,620,000     | 2021年7月13日 | 806,909     |
| USD  | 99,201,425    | EUR  | 83,098,958     | 2021年7月30日 | 243,465     |
| USD  | 7,668,034     | GBP  | 5,431,000      | 2021年7月13日 | 155,898     |
| USD  | 4,044,422     | GBP  | 2,908,731      | 2021年7月30日 | 20,898      |
| USD  | 411,526       | EUR  | 338,000        | 2021年7月13日 | 9,164       |
| USD  | 331,233       | GBP  | 234,000        | 2021年7月13日 | 7,566       |
| USD  | 305,742       | EUR  | 252,000        | 2021年7月13日 | 5,756       |
| USD  | 259,304       | EUR  | 213,000        | 2021年7月13日 | 5,745       |
| USD  | 1,600,000     | IDR  | 23,168,000,000 | 2021年7月16日 | 4,413       |
| USD  | 1,400,000     | INR  | 104,073,200    | 2021年7月16日 | 3,536       |
| USD  | 120,870       | EUR  | 99,255         | 2021年7月14日 | 2,712       |
| USD  | 431,362       | GBP  | 310,000        | 2021年7月13日 | 2,572       |
| USD  | 102,159       | EUR  | 84,000         | 2021年7月13日 | 2,164       |
| USD  | 125,868       | EUR  | 104,000        | 2021年7月13日 | 2,065       |
| USD  | 722,448       | EUR  | 605,000        | 2021年7月28日 | 2,018       |
| USD  | 401,815       | EUR  | 336,000        | 2021年7月13日 | 1,834       |
| USD  | 263,124       | GBP  | 189,000        | 2021年7月13日 | 1,701       |
| USD  | 475,330       | EUR  | 398,000        | 2021年7月13日 | 1,542       |

| 購入通貨 | 購入金額            | 売却通貨 | 売却金額       | 満期日        | 未実現損益(米ドル)  |
|------|-----------------|------|------------|------------|-------------|
| USD  | 157,728         | GBP  | 113,000    | 2021年7月13日 | 1,428       |
| USD  | 76,423          | EUR  | 63,000     | 2021年7月13日 | 1,427       |
| USD  | 538,206         | EUR  | 451,000    | 2021年7月13日 | 1,326       |
| USD  | 340,477         | EUR  | 285,000    | 2021年7月13日 | 1,207       |
| USD  | 135,000         | GBP  | 97,000     | 2021年7月13日 | 830         |
| EUR  | 325,105         | USD  | 386,739    | 2021年7月7日  | 225         |
| USD  | 56,085          | EUR  | 47,000     | 2021年7月13日 | 135         |
| USD  | 135,635         | GBP  | 98,000     | 2021年7月13日 | 83          |
| EUR  | 119,000         | USD  | 141,709    | 2021年7月13日 | (49)        |
| GBP  | 100,250         | USD  | 138,747    | 2021年7月7日  | (85)        |
| EUR  | 63,000          | USD  | 75,108     | 2021年7月13日 | (112)       |
| USD  | 158,210         | EUR  | 133,000    | 2021年7月13日 | (116)       |
| EUR  | 103,000         | USD  | 122,730    | 2021年7月13日 | (117)       |
| GBP  | 105,000         | USD  | 145,363    | 2021年7月13日 | (128)       |
| EUR  | 51,000          | USD  | 60,886     | 2021年7月13日 | (175)       |
| USD  | 350,969         | EUR  | 295,000    | 2021年7月13日 | (205)       |
| EUR  | 340,000         | USD  | 405,642    | 2021年7月13日 | (899)       |
| EUR  | 49,000          | USD  | 59,669     | 2021年7月13日 | (1,339)     |
| GBP  | 103,000         | USD  | 144,970    | 2021年7月13日 | (2,501)     |
| USD  | 1,700,000       | CNY  | 11,065,300 | 2021年9月17日 | (3,386)     |
| GBP  | 534,000         | USD  | 742,189    | 2021年7月13日 | (3,563)     |
| EUR  | 255,000         | USD  | 309,034    | 2021年7月13日 | (5,477)     |
| EUR  | 279,000         | USD  | 339,985    | 2021年7月13日 | (7,858)     |
| EUR  | 537,000         | USD  | 651,180    | 2021年7月13日 | (11,924)    |
| CNY  | 171,812,835     | USD  | 26,712,194 | 2021年9月17日 | (263,428)   |
| IDR  | 380,677,217,862 | USD  | 26,587,317 | 2021年7月16日 | (369,972)   |
| INR  | 1,930,402,816   | USD  | 26,391,813 | 2021年7月16日 | (489,482)   |
|      |                 |      |            |            | (1,896,882) |

## 注記2－先物契約

2021年6月30日現在、ファンドは以下の未決済先物契約を有していた。

| 通貨               | 契約数  | 銘柄名                    | 満期日     | 評価金額<br>(米ドル) | 未実現損益<br>(米ドル) |
|------------------|------|------------------------|---------|---------------|----------------|
| <b>買い持ちポジション</b> |      |                        |         |               |                |
| USD              | 26   | FUT US LONG BOND(CBT)  | 2021年9月 | 4,181,938     | 91,750         |
| USD              | 9    | FUT US 2YR NOTE (CBT)  | 2021年9月 | 1,982,953     | (3,587)        |
| USD              | 3    | FUT US 5YR NOTE (CBT)  | 2021年9月 | 370,359       | (1,359)        |
|                  |      |                        |         | 6,535,250     | 86,804         |
| <b>売り持ちポジション</b> |      |                        |         |               |                |
| EUR              | (1)  | FUT EURO-BUND          | 2021年9月 | (205,471)     | (1,500)        |
| GBP              | (2)  | FUT LONG GILT          | 2021年9月 | (354,474)     | (3,472)        |
| USD              | (5)  | FUT US ULTRA BOND CBT  | 2021年9月 | (965,156)     | (30,656)       |
| USD              | (40) | FUT US 10YR NOTE (CBT) | 2021年9月 | (5,301,875)   | (21,024)       |
| USD              | (70) | FUT US 10YR ULTRA      | 2021年9月 | (10,307,500)  | (116,007)      |
|                  |      |                        |         | (17,134,476)  | (172,659)      |
|                  |      |                        |         |               | (85,855)       |

## 注記3－クレジット・デフォルト・スワップ契約

2021年6月30日現在、ファンドは以下の未決済クレジット・デフォルト・スワップ契約を有していた。

| 通貨                    | 額面      | 銘柄名                                 | 満期日         | 未実現損益(米ドル) |
|-----------------------|---------|-------------------------------------|-------------|------------|
| <b>プロテクション売りポジション</b> |         |                                     |             |            |
| EUR                   | 500,000 | CDS WIND ACQUISITION 500BP 20/12/21 | 2021年12月20日 | 14,141     |
|                       |         |                                     |             | 14,141     |

# 野村マネー マザーファンド

## 運用報告書

第20期（決算日2022年8月19日）

作成対象期間（2021年8月20日～2022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

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近 5 期の運用実績

| 決 算 期             | 基 準     | 価 額       |  | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|-------------------|---------|-----------|--|-----------|-----------|---------|
|                   |         | 期 騰 落 中 率 |  |           |           |         |
|                   | 円       | %         |  | %         | %         | 百万円     |
| 16期(2018年 8 月20日) | 10, 206 | △0.0      |  | 38.7      | —         | 13, 511 |
| 17期(2019年 8 月19日) | 10, 205 | △0.0      |  | 59.3      | —         | 8, 458  |
| 18期(2020年 8 月19日) | 10, 203 | △0.0      |  | 68.2      | —         | 3, 175  |
| 19期(2021年 8 月19日) | 10, 200 | △0.0      |  | 60.1      | —         | 9, 159  |
| 20期(2022年 8 月19日) | 10, 199 | △0.0      |  | 57.5      | —         | 7, 850  |

\* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

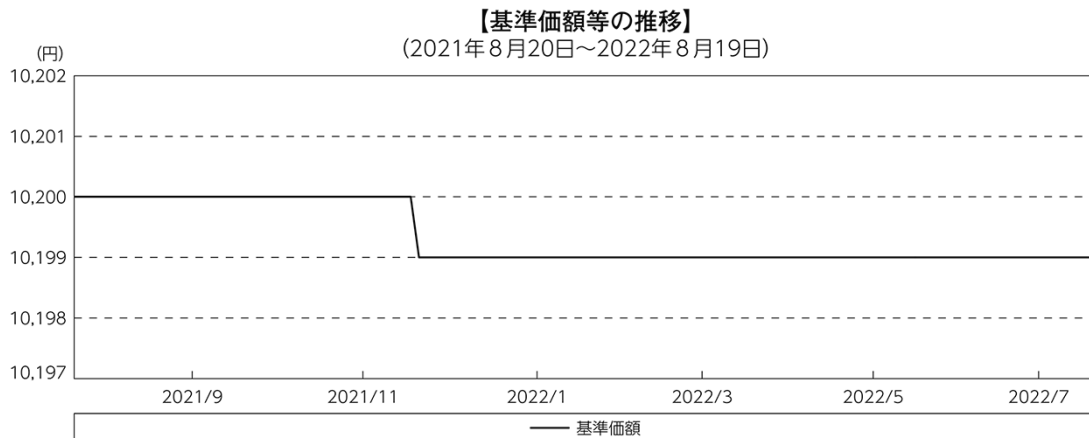
| 年 月 日                 | 基 準     | 価 額   |  | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 券 率 |
|-----------------------|---------|-------|--|-----------|-----------|-----|
|                       |         | 騰 落 率 |  |           |           |     |
| (期 首)<br>2021年 8 月19日 | 円       | %     |  | %         | %         | %   |
|                       | 10, 200 | —     |  | 60.1      | —         | —   |
| 8 月末                  | 10, 200 | 0.0   |  | 56.8      | —         | —   |
| 9 月末                  | 10, 200 | 0.0   |  | 55.1      | —         | —   |
| 10月末                  | 10, 200 | 0.0   |  | 51.6      | —         | —   |
| 11月末                  | 10, 200 | 0.0   |  | 54.5      | —         | —   |
| 12月末                  | 10, 199 | △0.0  |  | 52.1      | —         | —   |
| 2022年 1 月末            | 10, 199 | △0.0  |  | 57.1      | —         | —   |
| 2 月末                  | 10, 199 | △0.0  |  | 57.5      | —         | —   |
| 3 月末                  | 10, 199 | △0.0  |  | 59.5      | —         | —   |
| 4 月末                  | 10, 199 | △0.0  |  | 60.1      | —         | —   |
| 5 月末                  | 10, 199 | △0.0  |  | 62.0      | —         | —   |
| 6 月末                  | 10, 199 | △0.0  |  | 55.6      | —         | —   |
| 7 月末                  | 10, 199 | △0.0  |  | 53.7      | —         | —   |
| (期 末)<br>2022年 8 月19日 | 10, 199 | △0.0  |  | 57.5      | —         | —   |

\* 騰落率は期首比です。

\* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



### ○基準価額の主な変動要因

投資している短期有価証券やコール・ローンなどのマイナス金利環境を要因とする支払利息等。

### ○投資環境

国内経済は、新型コロナウイルス感染症による厳しい状況が緩和される中で、消費や雇用環境などには持ち直しの動きが見られました。このような中、日本銀行は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続し、2021年12月には、2022年3月末が期限となっていた「新型コロナ対応資金繰り支援特別プログラム」について中小企業向けに部分的な延長を決定しました。

TDB(国庫短期証券)3ヵ月物の利回りは、期を通して概ね－0.1%台で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は0～－0.05%程度で推移しました。

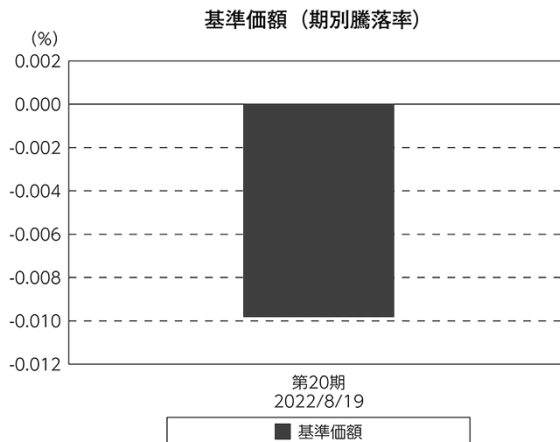
## ○当ファンドのポートフォリオ

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。

## ○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。

日本銀行によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年 8 月20日～2022年 8 月19日)

該当事項はございません。

○ 売 買 及 び 取 引 の 状 況

(2021年 8 月20日～2022年 8 月19日)

公社債

|            |                | 買 付 額             | 売 付 額                    |
|------------|----------------|-------------------|--------------------------|
| 国<br><br>内 | 地方債証券          | 千円<br>4, 055, 682 | 千円<br>—<br>(4, 600, 000) |
|            | 特殊債券           | 7, 031, 417       | —<br>(6, 457, 000)       |
|            | 社債券（投資法人債券を含む） | 2, 136, 048       | —<br>(3, 130, 000)       |

\* 金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）  
\* 単位未満は切り捨て。  
\* （ ） 内は償還等による増減分です。  
\* 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。

○ 利害関係人との取引状況等

(2021年 8 月20日～2022年 8 月19日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等<br>A           |               |           | 売付額等<br>C           |               |        |
|-----|---------------------|---------------|-----------|---------------------|---------------|--------|
|     | うち利害関係人<br>との取引状況 B | $\frac{B}{A}$ |           | うち利害関係人<br>との取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |        |
| 公社債 | 百万円<br>13, 223      | 百万円<br>30     | %<br>0. 2 | 百万円<br>—            | 百万円<br>—      | %<br>— |

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証券株式会社です。

○組入資産の明細

(2022年 8 月19日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区 分        | 当 期 末       |             |         |                     |           |      |        |
|------------|-------------|-------------|---------|---------------------|-----------|------|--------|
|            | 額 面 金 額     | 評 価 額       | 組 入 比 率 | うちB B格以下<br>組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 |      |        |
|            |             |             |         |                     | 5年以上      | 2年以上 | 2年未満   |
|            | 千円          | 千円          | %       | %                   | %         | %    | %      |
| 地方債証券      | 750,000     | 750,520     | 9.6     | —                   | —         | —    | 9.6    |
|            | ( 750,000)  | ( 750,520)  | ( 9.6)  | (—)                 | (—)       | (—)  | ( 9.6) |
| 特殊債券       | 2,430,000   | 2,431,889   | 31.0    | —                   | —         | —    | 31.0   |
| (除く金融債)    | (2,430,000) | (2,431,889) | (31.0)  | (—)                 | (—)       | (—)  | (31.0) |
| 金融債券       | 530,000     | 530,049     | 6.8     | —                   | —         | —    | 6.8    |
|            | ( 530,000)  | ( 530,049)  | ( 6.8)  | (—)                 | (—)       | (—)  | ( 6.8) |
| 普通社債券      | 800,000     | 800,923     | 10.2    | —                   | —         | —    | 10.2   |
| (含む投資法人債券) | ( 800,000)  | ( 800,923)  | (10.2)  | (—)                 | (—)       | (—)  | (10.2) |
| 合 計        | 4,510,000   | 4,513,382   | 57.5    | —                   | —         | —    | 57.5   |
|            | (4,510,000) | (4,513,382) | (57.5)  | (—)                 | (—)       | (—)  | (57.5) |

\* ( ) 内は非上場債で内書きです。

\*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\*金額の単位未満は切り捨て。

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

\*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄                          | 柄 | 当 期 末 |           |           |
|-----------------------------|---|-------|-----------|-----------|
|                             |   | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     |
| 地方債証券                       |   | %     | 千円        | 千円        |
| 東京都 公募第711回                 |   | 0.82  | 300,000   | 300,218   |
| 福岡県 公募平成24年度第4回             |   | 0.84  | 50,000    | 50,007    |
| 千葉県 公募平成24年度第5回             |   | 0.82  | 100,000   | 100,074   |
| 共同発行市場地方債 公募第114回           |   | 0.82  | 300,000   | 300,220   |
| 小 計                         |   |       | 750,000   | 750,520   |
| 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 財投機関債第96回 |   | 0.796 | 300,000   | 300,221   |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第13回 |   | 2.28  | 150,000   | 150,305   |
| 地方公共団体金融機構債券 第40回           |   | 0.825 | 110,000   | 110,101   |
| 地方公共団体金融機構債券 第41回           |   | 0.801 | 100,000   | 100,146   |
| 地方公共団体金融機構債券 第42回           |   | 0.801 | 40,000    | 40,086    |
| 日本政策金融公庫社債 第30回財投機関債        |   | 0.825 | 300,000   | 300,456   |
| 都市再生債券 財投機関債第68回            |   | 0.854 | 200,000   | 200,159   |
| 都市再生債券 財投機関債第71回            |   | 0.767 | 200,000   | 200,131   |
| 日本学生支援債券 財投機関債第60回          |   | 0.001 | 300,000   | 300,000   |
| 日本学生支援債券 財投機関債第61回          |   | 0.001 | 100,000   | 100,000   |
| 国際協力機構債券 第14回財投機関債          |   | 0.825 | 300,000   | 300,221   |
| 東日本高速道路 第48回                |   | 0.09  | 100,000   | 100,032   |
| 西日本高速道路 第37回                |   | 0.09  | 130,000   | 130,016   |
| 西日本高速道路 第38回                |   | 0.09  | 100,000   | 100,010   |
| 小 計                         |   |       | 2,430,000 | 2,431,889 |
| 金融債券                        |   |       |           |           |
| 商工債券 利付第811回い号              |   | 0.17  | 30,000    | 30,018    |
| しんきん中金債券 利付第333回            |   | 0.09  | 200,000   | 200,011   |
| 商工債券 利付(3年)第236回            |   | 0.02  | 300,000   | 300,019   |
| 小 計                         |   |       | 530,000   | 530,049   |
| 普通社債券(含む投資法人債券)             |   |       |           |           |
| 伊藤忠商事 第67回社債間限定同順位特約付       |   | 0.964 | 100,000   | 100,052   |
| 東京三菱銀行 第57回特定社債間限定同順位特約付    |   | 2.22  | 100,000   | 100,408   |
| 三井不動産 第46回社債間限定同順位特約付       |   | 0.964 | 200,000   | 200,063   |
| 三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無     |   | 0.929 | 300,000   | 300,205   |
| 電源開発 第35回社債間限定同順位特約付        |   | 1.126 | 100,000   | 100,193   |
| 小 計                         |   |       | 800,000   | 800,923   |
| 合 計                         |   |       | 4,510,000 | 4,513,382 |

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年8月19日現在)

| 項 目          | 当 期 末     |       |
|--------------|-----------|-------|
|              | 評 価 額     | 比 率   |
|              | 千円        | %     |
| 公社債          | 4,513,382 | 57.5  |
| コール・ローン等、その他 | 3,340,370 | 42.5  |
| 投資信託財産総額     | 7,853,752 | 100.0 |

\*金額の単位未満は切り捨て。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年8月19日現在)

| 項 目             | 当 期 末          |
|-----------------|----------------|
|                 | 円              |
| (A) 資産          | 7,853,752,692  |
| コール・ローン等        | 3,326,621,034  |
| 公社債(評価額)        | 4,513,382,357  |
| 未収利息            | 7,215,305      |
| 前払費用            | 6,533,996      |
| (B) 負債          | 3,470,854      |
| 未払解約金           | 3,470,000      |
| 未払利息            | 854            |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 7,850,281,838  |
| 元本              | 7,697,164,972  |
| 次期繰越損益金         | 153,116,866    |
| (D) 受益権総口数      | 7,697,164,972口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D) | 10,199円        |

(注) 期首元本額は8,979,256,768円、期中追加設定元本額は3,202,453,404円、期中一部解約元本額は4,484,545,200円、1口当たり純資産額は1.0199円です。

## ○損益の状況 (2021年8月20日～2022年8月19日)

| 項 目            | 当 期          |
|----------------|--------------|
|                | 円            |
| (A) 配当等収益      | 23,315,784   |
| 受取利息           | 23,990,043   |
| 支払利息           | △ 674,259    |
| (B) 有価証券売買損益   | △ 24,456,523 |
| 売買損            | △ 24,456,523 |
| (C) 当期損益金(A＋B) | △ 1,140,739  |
| (D) 前期繰越損益金    | 179,893,174  |
| (E) 追加信託差損益金   | 63,852,596   |
| (F) 解約差損益金     | △ 89,488,165 |
| (G) 計(C＋D＋E＋F) | 153,116,866  |
| 次期繰越損益金(G)     | 153,116,866  |

\*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。

## ○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<br>元本額    |
|-----------------------------------------|---------------|
|                                         | 円             |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Iプライス(適格機関投資家専用)  | 1,997,050,289 |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)IIプライス(適格機関投資家専用) | 1,941,761,887 |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)IIプライス(適格機関投資家専用) | 1,503,668,510 |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(非課税適格機関投資家専用)  | 1,248,281,712 |
| 野村世界業種別投資シリーズ(マネーボール・ファンド)              | 441,709,194   |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家転売制限付)  | 188,174,367   |
| ノムラ・アジア・シリーズ(マネーボール・ファンド)               | 128,372,175   |
| 野村DC運用戦略ファンド                            | 85,180,134    |
| 野村世界高金利通貨投資信                            | 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・イールド債券投資(円コース)毎月分配型          | 984,834       |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(資源国通貨コース)毎月分配型      | 984,834       |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(アジア通貨コース)毎月分配型      | 984,834       |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(円コース)年2回決算型         | 984,834       |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(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・イールド債券投資(アジア通貨コース)年2回決算型     | 984,834       |
| 野村グローバルCB投資(円コース)毎月分配型                  | 984,543       |
| 野村グローバルCB投資(資源国通貨コース)毎月分配型              | 984,543       |
| 野村グローバルCB投資(アジア通貨コース)毎月分配型              | 984,543       |
| 野村グローバルCB投資(円コース)年2回決算型                 | 984,543       |
| 野村グローバルCB投資(資源国通貨コース)年2回決算型             | 984,543       |
| 野村グローバルCB投資(アジア通貨コース)年2回決算型             | 984,543       |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(円コース)毎月分配型          | 984,252       |

| ファンド名                                 | 当期末<br>元本額 |
|---------------------------------------|------------|
|                                       | 円          |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(豪ドルコース)毎月分配型      | 984,252    |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型  | 984,252    |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(円コース)年2回決算型       | 984,252    |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(豪ドルコース)年2回決算型     | 984,252    |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型 | 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    |
| 野村テンブルトン・トータル・リターン Aコース               | 983,381    |
| 野村テンブルトン・トータル・リターン Cコース               | 983,381    |
| 野村テンブルトン・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・イールド債券投資信(円コース)毎月分配型          | 982,898    |

| 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(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      | 982,609 |
| 野村ドイチエ・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  | 982,609 |
| 野村新世界高金利通貨投信                          | 982,608 |
| 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(南アフリカランドコース) 毎月分配型    | 982,608 |
| 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 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース) 毎月分配型        | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース) 毎月分配型    | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース) 毎月分配型   | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース) 毎月分配型      | 982,608 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルレアルコース) 年2回決算型   | 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 |
| 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 |

| ファンド名                                 | 当期末     |
|---------------------------------------|---------|
|                                       | 元本額     |
|                                       | 円       |
| 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 |
| 野村グローバルボンド投信 Bコース                     | 980,489 |
| 野村グローバルボンド投信 Dコース                     | 980,489 |
| 野村グローバルボンド投信 Fコース                     | 980,489 |
| 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 |
| グローバル・ストック Dコース                       | 979,528 |
| 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(インドルピーコース) 毎月分配型          | 149,947 |
| 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 |
| 野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース) 毎月分配型           | 123,377 |
| 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(ユーロコース) 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  |
| 野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース) 毎月分配型        | 98,261  |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース) 年2回決算型         | 98,261  |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型  | 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  |
| 野村ドイチエ・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  |
| 野村ドイチエ・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  |
| 野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース               | 98,261  |
| 野村ドイチエ・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  |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型   | 98,260  |
| 野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース) 年2回決算型       | 98,260  |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース) 年2回決算型       | 98,260  |
| 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  |
| 野村グローバルボンド投信 Aコース                     | 98,049  |
| 野村グローバルボンド投信 Cコース                     | 98,049  |
| 野村グローバルボンド投信 Eコース                     | 98,049  |
| 野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース                  | 98,020  |

| ファンド名                            | 当期末    |
|----------------------------------|--------|
|                                  | 元本額    |
|                                  | 円      |
| 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)のむらっぴ・ファンド(普通型)         | 98,001 |
| (年6%目標払出)のむらっぴ・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 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)年2回決算型     | 63,772 |
| 野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)毎月分配型     | 48,092 |
| 野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型        | 41,054 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型   | 27,600 |
| 野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型         | 23,859 |
| 野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)年2回決算型      | 18,851 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型  | 14,308 |
| 野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)年2回決算型    | 13,741 |
| ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)            | 10,000 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)年2回決算型    | 9,826  |
| 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テンブルトン・トータル・リターン Aコース        | 9,818  |
| 野村DCテンブルトン・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(メキシコペソコース)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  |
| 野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)年2回決算型     | 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  |
| 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  |

| ファンド名                                    | 当期末   |
|------------------------------------------|-------|
|                                          | 元本額   |
|                                          | 円     |
| 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 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型            | 9,805 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型         | 9,805 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型           | 9,805 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型        | 9,805 |
| 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 |
| 野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)年2回決算型                | 3,114 |
| 野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)毎月分配型                 | 966   |

## ○お知らせ

該当事項はございません。