

# 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

## 運用報告書(全体版)

第94期(決算日2022年6月15日) 第95期(決算日2022年7月15日) 第96期(決算日2022年8月15日)  
第97期(決算日2022年9月15日) 第98期(決算日2022年10月17日) 第99期(決算日2022年11月15日)

作成対象期間(2022年5月17日～2022年11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     | 2014年8月11日から2024年5月15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・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムクラスUSD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、米ドル建ての高利回り事業債（「ハイ・イールド・ボンド」または「ハイ・イールド債」といいます。）を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行ないます。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・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムクラスUSD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 | 野村新米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）<br>毎月分配型                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | ノムラ・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムクラスUSD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・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムクラスUSD                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 米ドル建ての高利回り事業債を主要投資対象とします。                                                                                                   |  |
|             | 野村マネー<br>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。                                                                                                   |  |
|             | 野村新米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）<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ないません。                                                                                  |  |
| 主 な 投 資 制 限 | 野村マネー<br>マザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 株式への投資は行ないません。                                                                                                              |  |
|             | 毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から、利子・配当等収益等をを中心に分配を行ないません。ただし、基準価額水準等によっては売買益等が中心となる場合があります。また、毎年5月および11月の決算時には、基準価額水準等を勘案し、上記分配相当額のほか、分配原資の範囲内で委託者が決定する額を付加して分配する場合があります。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 方 針     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                             |  |

### 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<br>(分配落) | 準 価 額 |     |             | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 投 資 信 託 純 資 産<br>証 入 比 率 総 額 |
|------------------|------------|-------|-----|-------------|-----------|-----------|------------------------------|
|                  |            | 税 分   | 込 配 | み 金 騰 落 中 率 |           |           |                              |
|                  | 円          |       | 円   | %           | %         | %         | 百万円                          |
| 70期(2020年6月15日)  | 9,687      |       | 30  | 4.1         | 0.0       | —         | 861                          |
| 71期(2020年7月15日)  | 9,703      |       | 30  | 0.5         | 0.0       | —         | 907                          |
| 72期(2020年8月17日)  | 9,906      |       | 30  | 2.4         | 0.0       | —         | 954                          |
| 73期(2020年9月15日)  | 9,834      |       | 30  | △0.4        | 0.0       | —         | 939                          |
| 74期(2020年10月15日) | 9,830      |       | 30  | 0.3         | 0.0       | —         | 950                          |
| 75期(2020年11月16日) | 9,854      |       | 30  | 0.5         | 0.0       | —         | 947                          |
| 76期(2020年12月15日) | 9,927      |       | 30  | 1.0         | 0.0       | —         | 938                          |
| 77期(2021年1月15日)  | 9,955      |       | 30  | 0.6         | 0.0       | —         | 949                          |
| 78期(2021年2月15日)  | 10,084     |       | 30  | 1.6         | 0.0       | —         | 955                          |
| 79期(2021年3月15日)  | 10,359     |       | 30  | 3.0         | 0.0       | —         | 975                          |
| 80期(2021年4月15日)  | 10,407     |       | 30  | 0.8         | 0.0       | —         | 965                          |
| 81期(2021年5月17日)  | 10,464     |       | 30  | 0.8         | 0.0       | —         | 975                          |
| 82期(2021年6月15日)  | 10,543     |       | 30  | 1.0         | 0.0       | —         | 977                          |
| 83期(2021年7月15日)  | 10,650     |       | 30  | 1.3         | 0.0       | —         | 804                          |
| 84期(2021年8月16日)  | 10,560     |       | 30  | △0.6        | 0.0       | —         | 799                          |
| 85期(2021年9月15日)  | 10,606     |       | 30  | 0.7         | 0.0       | —         | 788                          |
| 86期(2021年10月15日) | 10,804     |       | 30  | 2.1         | 0.0       | —         | 801                          |
| 87期(2021年11月15日) | 10,879     |       | 30  | 1.0         | 0.0       | —         | 805                          |
| 88期(2021年12月15日) | 10,751     |       | 30  | △0.9        | 0.0       | —         | 780                          |
| 89期(2022年1月17日)  | 10,735     |       | 30  | 0.1         | 0.0       | —         | 771                          |
| 90期(2022年2月15日)  | 10,528     |       | 30  | △1.6        | 0.0       | —         | 766                          |
| 91期(2022年3月15日)  | 10,567     |       | 30  | 0.7         | 0.0       | —         | 765                          |
| 92期(2022年4月15日)  | 11,087     |       | 30  | 5.2         | 0.0       | —         | 798                          |
| 93期(2022年5月16日)  | 10,930     |       | 30  | △1.1        | 0.0       | —         | 786                          |
| 94期(2022年6月15日)  | 11,110     |       | 30  | 1.9         | 0.0       | —         | 794                          |
| 95期(2022年7月15日)  | 11,416     |       | 30  | 3.0         | 0.0       | —         | 834                          |
| 96期(2022年8月15日)  | 11,539     |       | 30  | 1.3         | 0.0       | —         | 845                          |
| 97期(2022年9月15日)  | 11,980     |       | 30  | 4.1         | 0.0       | —         | 869                          |
| 98期(2022年10月17日) | 11,754     |       | 30  | △1.6        | 0.0       | —         | 852                          |
| 99期(2022年11月15日) | 11,437     |       | 30  | △2.4        | 0.0       | —         | 896                          |

\* 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 組 入 比 率 |
|-------|--------------|--------|-------|-----------|-----------|-------------------|
|       |              |        | 騰 落 率 |           |           |                   |
| 第94期  | (期 首)        | 円      | %     | %         | %         | %                 |
|       | 2022年 5 月16日 | 10,930 | —     | 0.0       | —         | 98.6              |
|       | 5 月末         | 11,011 | 0.7   | 0.0       | —         | 97.6              |
|       | (期 末)        |        |       |           |           |                   |
|       | 2022年 6 月15日 | 11,140 | 1.9   | 0.0       | —         | 97.4              |
| 第95期  | (期 首)        |        |       |           |           |                   |
|       | 2022年 6 月15日 | 11,110 | —     | 0.0       | —         | 97.4              |
|       | 6 月末         | 11,214 | 0.9   | 0.0       | —         | 95.7              |
|       | (期 末)        |        |       |           |           |                   |
|       | 2022年 7 月15日 | 11,446 | 3.0   | 0.0       | —         | 98.9              |
| 第96期  | (期 首)        |        |       |           |           |                   |
|       | 2022年 7 月15日 | 11,416 | —     | 0.0       | —         | 98.9              |
|       | 7 月末         | 11,501 | 0.7   | 0.0       | —         | 98.8              |
|       | (期 末)        |        |       |           |           |                   |
|       | 2022年 8 月15日 | 11,569 | 1.3   | 0.0       | —         | 98.7              |
| 第97期  | (期 首)        |        |       |           |           |                   |
|       | 2022年 8 月15日 | 11,539 | —     | 0.0       | —         | 98.7              |
|       | 8 月末         | 11,614 | 0.6   | 0.0       | —         | 98.8              |
|       | (期 末)        |        |       |           |           |                   |
|       | 2022年 9 月15日 | 12,010 | 4.1   | 0.0       | —         | 98.5              |
| 第98期  | (期 首)        |        |       |           |           |                   |
|       | 2022年 9 月15日 | 11,980 | —     | 0.0       | —         | 98.5              |
|       | 9 月末         | 11,520 | △3.8  | 0.0       | —         | 98.7              |
|       | (期 末)        |        |       |           |           |                   |
|       | 2022年10月17日  | 11,784 | △1.6  | 0.0       | —         | 98.6              |
| 第99期  | (期 首)        |        |       |           |           |                   |
|       | 2022年10月17日  | 11,754 | —     | 0.0       | —         | 98.6              |
|       | 10月末         | 11,955 | 1.7   | 0.0       | —         | 98.8              |
|       | (期 末)        |        |       |           |           |                   |
|       | 2022年11月15日  | 11,467 | △2.4  | 0.0       | —         | 98.7              |

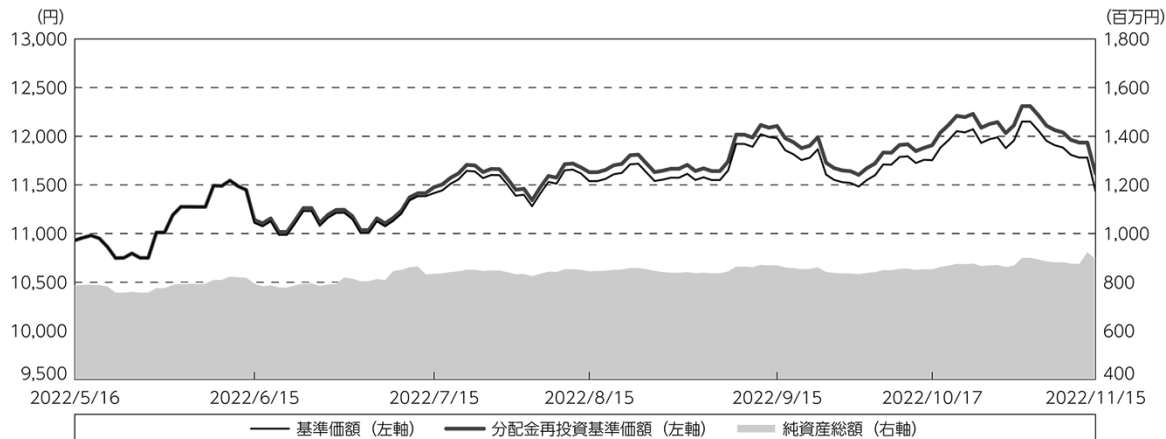
\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

\* 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94期首：10,930円

第99期末：11,437円（既払分配金（税込み）：180円）

騰落率：6.3%（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5月16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

- ・実質的に投資しているハイ・イールド債券からのインカムゲイン（利息収入）
- ・実質的に投資しているハイ・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／米ドルの為替変動

## ○投資環境

米国ハイ・イールド債券市場は、当作成期間で値下がりとなりました（トータルリターン・現地通貨ベース）。当作成期首は、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上昇して始まりましたが、6月に入り、市場予想を上回る米経済指標を受け米長期金利が上昇したことにより下落しました。7月以降は、インフレのピークの兆しを示す米経済指標を受けFRB（米連邦準備制度理事会）による利上げペースが緩むとの見方が強まり上昇しましたが、8月後半の、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を受けて下落しました。10月に入り、予想を上回る米企業の決算発表でリスクセンチメント（市場心理）が改善したことなどから反発したものの、当作成期間は値下がりとなりました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### 【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】

〔ノムラ・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムークラスUSD〕および〔野村マネー マザーファンド〕の受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする〔ノムラ・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムークラスUSD〕の受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持しました。

### 〔ノムラ・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムークラスUSD〕

主要投資対象である〔ノムラ・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカム〕における信用格付け別比率については、2022年10月末時点で、BBB格0.3%、BB格40.7%、B格50.1%、CCC格以下4.0%となりました。

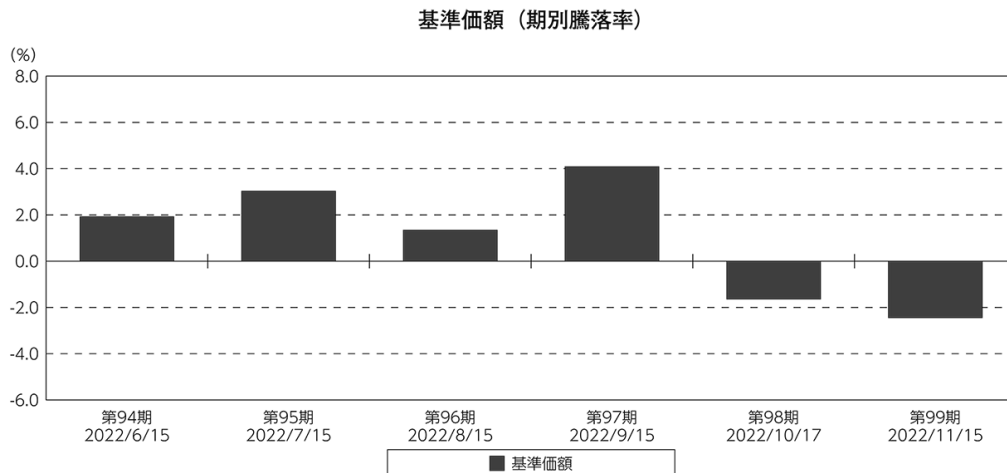
### 【野村マネー マザーファンド】

残存1年以内の公社債等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

収益分配金については、各期の利子・配当等収入、信託報酬などの諸経費を勘案して決定しました。

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94期                      | 第95期                      | 第96期                      | 第97期                      | 第98期                       | 第99期                        |
|-----------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|
|           | 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 | 2022年9月16日～<br>2022年10月17日 | 2022年10月18日～<br>2022年11月15日 |
| 当期分配金     | 30                        | 30                        | 30                        | 30                        | 30                         | 30                          |
| （対基準価額比率） | 0.269%                    | 0.262%                    | 0.259%                    | 0.250%                    | 0.255%                     | 0.262%                      |
| 当期の収益     | 30                        | 30                        | 30                        | 30                        | 30                         | 30                          |
| 当期の収益以外   | —                         | —                         | —                         | —                         | —                          | —                           |
| 翌期繰越分配対象額 | 3,317                     | 3,459                     | 3,582                     | 4,022                     | 4,041                      | 4,061                       |

(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

### 【野村新米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）毎月分配型】

〔ノムラ・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムークラスUSD〕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・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムークラスUSD〕受益証券への投資比率を概ね90%以上に維持します。

### 【ノムラ・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムークラスUSD】

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

米国ハイ・イールド債市場は、短期的には高インフレやFRBの金融引き締め姿勢などに大きく左右されると考えております。FRBによる金融引き締めにより金利が上昇する中でスプレッド（利回り格差）は拡大しており、低水準を維持していたデフォルト（債務不履行）率は今後24ヵ月間のどこかで再び上昇すると見込まれるものの、新型コロナウイルスの流行により経済が大打撃を受けた2020年時のピークに達することはないと予想しております。米国ハイ・イールド債の利回り水準は9%を超え、投資家心理は弱気に見えるものの、長期的に見ると割安な水準と考えられることを考慮すると、米国ハイ・イールド債の需要は高まると考えます。

### 【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。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願いいたします。

※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 5 月17日～2022年11月15日)

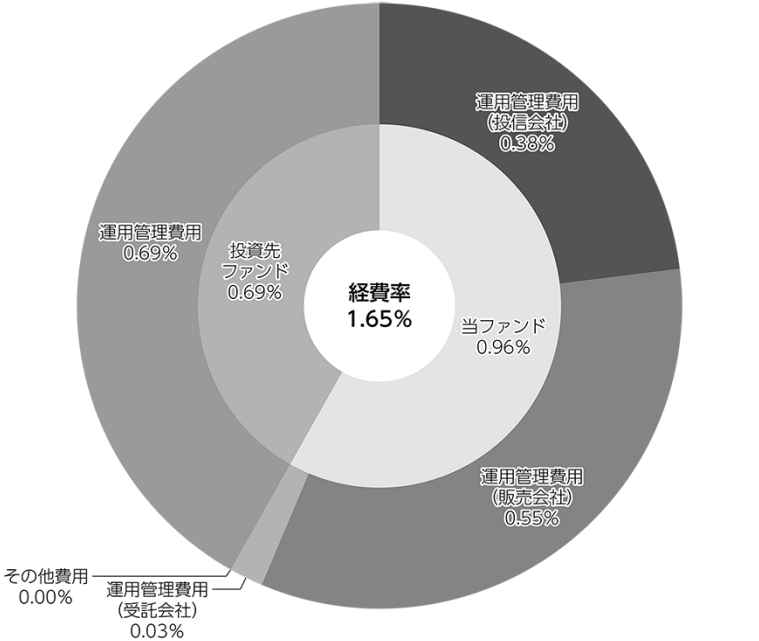
| 項 目                     | 第94期～第99期 |            | 項 目 の 概 要                                    |
|-------------------------|-----------|------------|----------------------------------------------|
|                         | 金 額       | 比 率        |                                              |
| (a) 信 託 報 酬             | 円<br>56   | %<br>0.485 | (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 )             | (22)      | (0.193)    | ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等   |
| ( 販 売 会 社 )             | (32)      | (0.276)    | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等 |
| ( 受 託 会 社 )             | ( 2 )     | (0.017)    | 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                     | 56        | 0.486      |                                              |
| 作成期間の平均基準価額は、11,469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1.65%です。



(単位: %)

|                    |      |
|--------------------|------|
| 経費率(①+②)           | 1.65 |
| ①当ファンドの費用の比率       | 0.96 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.69 |

(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5月17日～2022年11月15日)

投資信託証券

| 銘柄 |                                          | 第94期～第99期   |               |            |              |
|----|------------------------------------------|-------------|---------------|------------|--------------|
|    |                                          | 買付          |               | 売付         |              |
|    |                                          | 口数          | 金額            | 口数         | 金額           |
| 国内 | ノムラ・カレンシー・ファンド-USハイ・イールド・ボンド・インカム・クラスUSD | 口<br>16,481 | 千円<br>157,859 | 口<br>7,892 | 千円<br>74,334 |

\*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5月17日～2022年11月15日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2022年11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93期末       | 第99期末       |               |           |
|----|------------------------------------------|-------------|-------------|---------------|-----------|
|    |                                          | 口数          | 口数          | 評価額           | 比率        |
|    | ノムラ・カレンシー・ファンド-USハイ・イールド・ボンド・インカム・クラスUSD | 口<br>83,963 | 口<br>92,552 | 千円<br>884,612 | %<br>98.7 |
| 合  | 計                                        | 83,963      | 92,552      | 884,612       | 98.7      |

\*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93期末   | 第99期末   |         |
|---------------|--|---------|---------|---------|
|               |  | 口数      | 口数      | 評価額     |
| 野村マネー マザーファンド |  | 千口<br>9 | 千口<br>9 | 千円<br>9 |

\*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11月15日現在)

| 項 目           | 第99期末         |           |
|---------------|---------------|-----------|
|               | 評 価 額         | 比 率       |
| 投資信託受益証券      | 千円<br>884,612 | %<br>93.4 |
| 野村マネー マザーファンド | 9             | 0.0       |
| コール・ローン等、その他  | 62,378        | 6.6       |
| 投資信託財産総額      | 946,999       | 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94期末        | 第95期末        | 第96期末        | 第97期末        | 第98期末         | 第99期末         |
|--------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|---------------|---------------|
|                    | 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 | 2022年10月17日現在 | 2022年11月15日現在 |
|                    | 円            | 円            | 円            | 円            | 円             | 円             |
| (A) 資産             | 797,226,411  | 869,675,908  | 850,203,479  | 872,105,957  | 855,741,048   | 946,999,899   |
| コール・ローン等           | 15,679,844   | 45,065,860   | 15,768,659   | 16,037,512   | 15,171,945    | 62,377,884    |
| 投資信託受益証券(評価額)      | 773,832,555  | 824,600,048  | 834,424,820  | 856,058,445  | 840,559,104   | 884,612,016   |
| 野村マネー マザーファンド(評価額) | 10,000       | 10,000       | 10,000       | 10,000       | 9,999         | 9,999         |
| 未収入金               | 7,704,012    | —            | —            | —            | —             | —             |
| (B) 負債             | 2,788,861    | 35,573,249   | 5,094,565    | 2,878,696    | 2,899,951     | 50,932,246    |
| 未払金                | —            | —            | 2,202,596    | —            | —             | 47,904,696    |
| 未払収益分配金            | 2,145,166    | 2,191,897    | 2,197,106    | 2,176,617    | 2,176,708     | 2,350,362     |
| 未払解約金              | 15,461       | 32,736,141   | —            | 2,009        | —             | —             |
| 未払信託報酬             | 626,818      | 643,748      | 693,294      | 698,481      | 721,593       | 675,567       |
| 未払利息               | 6            | 13           | 3            | 13           | 19            | 94            |
| その他未払費用            | 1,410        | 1,450        | 1,566        | 1,576        | 1,631         | 1,527         |
| (C) 純資産総額(A－B)     | 794,437,550  | 834,102,659  | 845,108,914  | 869,227,261  | 852,841,097   | 896,067,653   |
| 元本                 | 715,055,455  | 730,632,609  | 732,368,939  | 725,539,259  | 725,569,388   | 783,454,179   |
| 次期繰越損益金            | 79,382,095   | 103,470,050  | 112,739,975  | 143,688,002  | 127,271,709   | 112,613,474   |
| (D) 受益権総口数         | 715,055,455口 | 730,632,609口 | 732,368,939口 | 725,539,259口 | 725,569,388口  | 783,454,179口  |
| 1万口当たり基準価額(C/D)    | 11,110円      | 11,416円      | 11,539円      | 11,980円      | 11,754円       | 11,437円       |

(注) 第94期首元本額は719,445,835円、第94～99期中追加設定元本額は126,180,106円、第94～99期中一部解約元本額は62,171,762円、1口当たり純資産額は、第94期1.1110円、第95期1.1416円、第96期1.1539円、第97期1.1980円、第98期1.1754円、第99期1.1437円です。

## ○損益の状況

| 項 目                   | 第94期                          | 第95期                          | 第96期                          | 第97期                          | 第98期                         | 第99期                        |
|-----------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|------------------------------|-----------------------------|
|                       | 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 | 2022年 9 月16日～<br>2022年10月17日 | 2022年10月18日～<br>2022年11月15日 |
|                       | 円                             | 円                             | 円                             | 円                             | 円                            | 円                           |
| (A) 配当等収益             | 4, 115, 237                   | 4, 139, 294                   | 4, 287, 075                   | 4, 252, 363                   | 4, 263, 722                  | 4, 357, 960                 |
| 受取配当金                 | 4, 115, 434                   | 4, 139, 625                   | 4, 287, 200                   | 4, 252, 642                   | 4, 264, 200                  | 4, 358, 700                 |
| 支払利息                  | △ 197                         | △ 331                         | △ 125                         | △ 279                         | △ 478                        | △ 740                       |
| (B) 有価証券売買損益          | 10, 864, 556                  | 20, 832, 588                  | 7, 622, 210                   | 30, 544, 930                  | △ 17, 787, 086               | △ 26, 571, 324              |
| 売買益                   | 11, 027, 384                  | 21, 442, 615                  | 7, 622, 198                   | 30, 560, 727                  | 12, 701                      | —                           |
| 売買損                   | △ 162, 828                    | △ 610, 027                    | 12                            | △ 15, 797                     | △ 17, 799, 787               | △ 26, 571, 324              |
| (C) 信託報酬等             | △ 628, 228                    | △ 645, 198                    | △ 694, 860                    | △ 700, 057                    | △ 723, 224                   | △ 677, 094                  |
| (D) 当期損益金 (A + B + C) | 14, 351, 565                  | 24, 326, 684                  | 11, 214, 425                  | 34, 097, 236                  | △ 14, 246, 588               | △ 22, 890, 458              |
| (E) 前期繰越損益金           | 54, 844, 048                  | 63, 880, 548                  | 86, 013, 151                  | 93, 903, 505                  | 125, 729, 321                | 109, 305, 946               |
| (F) 追加信託差損益金          | 12, 331, 648                  | 17, 454, 715                  | 17, 709, 505                  | 17, 863, 878                  | 17, 965, 684                 | 28, 548, 348                |
| (配当等相当額)              | ( 157, 534, 556)              | ( 166, 737, 904)              | ( 167, 340, 816)              | ( 166, 055, 109)              | ( 166, 163, 988)             | ( 189, 777, 521)            |
| (売買損益相当額)             | (△145, 202, 908)              | (△149, 283, 189)              | (△149, 631, 311)              | (△148, 191, 231)              | (△148, 198, 304)             | (△161, 229, 173)            |
| (G) 計 (D + E + F)     | 81, 527, 261                  | 105, 661, 947                 | 114, 937, 081                 | 145, 864, 619                 | 129, 448, 417                | 114, 963, 836               |
| (H) 収益分配金             | △ 2, 145, 166                 | △ 2, 191, 897                 | △ 2, 197, 106                 | △ 2, 176, 617                 | △ 2, 176, 708                | △ 2, 350, 362               |
| 次期繰越損益金 (G + H)       | 79, 382, 095                  | 103, 470, 050                 | 112, 739, 975                 | 143, 688, 002                 | 127, 271, 709                | 112, 613, 474               |
| 追加信託差損益金              | 12, 331, 648                  | 17, 454, 715                  | 17, 709, 505                  | 17, 863, 878                  | 17, 965, 684                 | 28, 548, 348                |
| (配当等相当額)              | ( 157, 534, 556)              | ( 166, 737, 904)              | ( 167, 340, 816)              | ( 166, 055, 109)              | ( 166, 163, 988)             | ( 189, 777, 521)            |
| (売買損益相当額)             | (△145, 202, 908)              | (△149, 283, 189)              | (△149, 631, 311)              | (△148, 191, 231)              | (△148, 198, 304)             | (△161, 229, 173)            |
| 分配準備積立金               | 79, 669, 510                  | 86, 015, 335                  | 95, 030, 470                  | 125, 824, 124                 | 127, 093, 113                | 128, 423, 530               |
| 繰越損益金                 | △ 12, 619, 063                | —                             | —                             | —                             | △ 17, 787, 088               | △ 44, 358, 404              |

\* 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 5 月17日～2022年11月15日) は以下の通りです。

| 項 目                           | 第94期                          | 第95期                          | 第96期                          | 第97期                          | 第98期                         | 第99期                        |
|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|------------------------------|-----------------------------|
|                               | 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 | 2022年 9 月16日～<br>2022年10月17日 | 2022年10月18日～<br>2022年11月15日 |
| a. 配当等収益 (経費控除後)              | 3, 942, 666円                  | 4, 032, 323円                  | 4, 036, 927円                  | 4, 166, 819円                  | 3, 540, 500円                 | 3, 680, 871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                            | 8, 291, 328円                  | 7, 177, 498円                  | 29, 930, 417円                 | 0円                           | 0円                          |
| c. 信託約款に定める収益調整金              | 157, 534, 556円                | 166, 737, 904円                | 167, 340, 816円                | 166, 055, 109円                | 166, 163, 988円               | 189, 777, 521円              |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金            | 77, 872, 010円                 | 75, 883, 581円                 | 86, 013, 151円                 | 93, 903, 505円                 | 125, 729, 321円               | 127, 093, 021円              |
| e. 分配対象収益 (a + b + c + d)     | 239, 349, 232円                | 254, 945, 136円                | 264, 568, 392円                | 294, 055, 850円                | 295, 433, 809円               | 320, 551, 413円              |
| f. 分配対象収益 (1 万口当たり)           | 3, 347円                       | 3, 489円                       | 3, 612円                       | 4, 052円                       | 4, 071円                      | 4, 091円                     |
| g. 分配金                        | 2, 145, 166円                  | 2, 191, 897円                  | 2, 197, 106円                  | 2, 176, 617円                  | 2, 176, 708円                 | 2, 350, 362円                |
| h. 分配金 (1 万口当たり)              | 30円                           | 30円                           | 30円                           | 30円                           | 30円                          | 30円                         |

○分配金のお知らせ

|                 | 第94期 | 第95期 | 第96期 | 第97期 | 第98期 | 第99期 |
|-----------------|------|------|------|------|------|------|
| 1 万口当たり分配金（税込み） | 30円  | 30円  | 30円  | 30円  | 30円  | 30円  |

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

○お知らせ

該当事項はございません。

ノムラ・カレンシー・ファンドーUSハイ・イールド・ボンド・インカムー  
クラスJPY、クラスAUD、クラスBRL、クラスZAR、クラスTRY、  
クラスUSD、クラスMXN

2021年9月30日決算  
(計算期間:2020年10月1日～2021年9月30日)

●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                                                                                                                                                                                                                 |
| 運 用 方 針                    | 米ドル建ての高利回り事業債を主要投資対象とし、インカムゲインの確保に加え、中長期的なキャピタルゲインの獲得を目指します。投資する事業債は、主としてBB＋格(S&P社)以下(B－格未満は除く)またはBa1格(Moody’s社)以下(B3格未満は除く)の格付が付与されている債券とします。格付をもたない債券への投資にあたっては、投資顧問会社によりB－格(S&P社)以上およびB3格(Moody’s社)以上の格付と同等と判断される債券へ投資を行ないます。 |
| 投 資 対 象                    | 米ドル建ての高利回り事業債                                                                                                                                                                                                                    |
| 受 託 会 社                    | グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー                                                                                                                                                                                                            |
| 投 資 顧 問 会 社                | 野村アセットマネジメント株式会社                                                                                                                                                                                                                 |
| 副 投 資 顧 問 会 社              | J.P.モルガン・インベストメント・マネージメント・インク                                                                                                                                                                                                    |
| 管 理 事 務 代 行 会 社<br>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。

運用計算書  
2021年9月30日に終了する計測期間  
(米ドル)

**収益**

|              |           |
|--------------|-----------|
| 債券利息(源泉税控除後) | 8,843,292 |
| 収益合計         | 8,843,292 |

**費用**

|        |           |
|--------|-----------|
| 投資顧問報酬 | 926,461   |
| 管理費用   | 168,327   |
| 保管費用   | 33,985    |
| 当座借越利息 | 209       |
| 取引銀行報酬 | 6,955     |
| 受託報酬   | 50,537    |
| 法務報酬   | 1,155     |
| 立替費用   | 8,414     |
| 専門家報酬  | 21,930    |
| 雑費用    | 20,583    |
| 費用合計   | 1,238,556 |

**純投資損益**

|                       |           |
|-----------------------|-----------|
| 投資有価証券売買に係る損益         | 727,760   |
| 外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益 | 5,001,533 |

**当期実現純損益**

|                   |           |
|-------------------|-----------|
| 投資有価証券評価差損益       | 7,113,339 |
| 外国為替先渡し契約に係る評価差損益 | 222,544   |

**当期評価差損益**

|                 |            |
|-----------------|------------|
| 運用の結果による純資産の増減額 | 20,669,912 |
|-----------------|------------|

|                             | 1口当たり純資産価格 | 発行済受益証券数  | 純資産           |
|-----------------------------|------------|-----------|---------------|
| Class FA JPY Units (in JPY) | 5,859      | 466,369   | 2,732,258,260 |
| Class FB AUD Units (in JPY) | 5,941      | 383,543   | 2,278,445,586 |
| Class FC BRL Units (in JPY) | 2,063      | 4,523,438 | 9,333,107,053 |
| Class FD ZAR Units (in JPY) | 3,204      | 136,004   | 435,816,359   |
| Class FE TRY Units (in JPY) | 1,548      | 735,410   | 1,138,600,591 |
| Class FF USD Units (in JPY) | 9,202      | 129,009   | 1,187,095,855 |
| Class FG MXN Units (in JPY) | 5,279      | 34,073    | 179,868,871   |

組入資産明細  
2021年9月30日現在  
(米ドル)

| 通貨                 | 種類 / 額面 <sup>(1)</sup> | 銘柄                                  | 評価額       | 純資産比率(%) |
|--------------------|------------------------|-------------------------------------|-----------|----------|
| <b>オーストラリア</b>     |                        |                                     |           |          |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                        |                                     |           |          |
| USD                | 117,000                | FMG RES AUG 2 4.3750% 01/04/31 144A | 121,095   | 0.08     |
|                    |                        |                                     | 121,095   | 0.08     |
|                    |                        | オーストラリア計                            | 121,095   | 0.08     |
| <b>カナダ</b>         |                        |                                     |           |          |
| <b>普通社債(固定金利債)</b> |                        |                                     |           |          |
| USD                | 1,215,000              | BAUSCH HLTH A 8.5000% 31/01/27 144A | 1,299,290 | 0.84     |
| USD                | 1,140,000              | VALEANT PHARM 9.0000% 15/12/25 144A | 1,202,699 | 0.78     |
| USD                | 786,000                | BAUSCH HEALTH 6.1250% 15/04/25 144A | 801,704   | 0.52     |
| USD                | 639,000                | NOVA CHEMICALS CORP 5% 01/05/25 144 | 674,944   | 0.44     |
| USD                | 578,000                | VALEANT PHARM 5.5000% 01/11/25 144A | 586,670   | 0.38     |
| USD                | 364,000                | MEG ENERGY CO 7.1250% 01/02/27 144A | 382,655   | 0.25     |
| USD                | 250,000                | GFL ENVIRON I 4.2500% 01/06/25 144A | 257,500   | 0.17     |
| USD                | 249,000                | BAUSCH HEALTH 7.0000% 15/01/28 144A | 253,980   | 0.16     |
| USD                | 245,000                | BAYTEX ENERGY 8.7500% 01/04/27 144A | 252,963   | 0.16     |
| USD                | 267,000                | BAUSCH HEALTH 5.0000% 15/02/29 144A | 248,160   | 0.16     |
| USD                | 235,000                | BAUSCH HEALTH 4.8750% 01/06/28 144A | 243,225   | 0.16     |
| USD                | 225,000                | NOVA CHEMICALS CORP 5.25% 01/06/27  | 236,700   | 0.15     |
| USD                | 170,000                | ALBERTA ENERGY 8.1250% 15/09/30     | 234,564   | 0.15     |
| USD                | 216,000                | PANTHER BF AG 6.2500% 15/05/26 144A | 227,070   | 0.15     |
| USD                | 211,000                | BAUSCH HEALTH 5.7500% 15/08/27 144A | 221,023   | 0.14     |
| USD                | 174,000                | GFL ENVIRON I 3.7500% 01/08/25 144A | 179,003   | 0.12     |
| USD                | 160,000                | VIDEOTRON LTD 3.6250% 15/06/29 144A | 162,998   | 0.11     |
| USD                | 162,000                | NOVA CHEMICAL 4.2500% 15/05/29 144A | 162,203   | 0.11     |
| USD                | 155,000                | 1011778 BC UL 4.0000% 15/10/30 144A | 152,869   | 0.10     |
| USD                | 154,000                | BAUSCH HEALTH 5.2500% 15/02/31 144A | 140,456   | 0.09     |
| USD                | 132,000                | GFL ENVIRON I 4.7500% 15/06/29 144A | 135,344   | 0.09     |
| USD                | 135,000                | BAUSCH HEALTH 5.0000% 30/01/28 144A | 127,204   | 0.08     |
| USD                | 124,000                | PRECISION DRI 7.1250% 15/01/26 144A | 127,100   | 0.08     |
| USD                | 120,000                | BAUSCH HEALTH 5.2500% 30/01/30 144A | 111,207   | 0.07     |
| USD                | 107,000                | GFL ENVIRON I 4.3750% 15/08/29 144A | 108,204   | 0.07     |
| USD                | 99,000                 | GFL ENVIRON I 4.0000% 01/08/28 144A | 98,258    | 0.06     |
| USD                | 95,000                 | BCULC 3.8750% 15/01/28 144A         | 95,827    | 0.06     |
| USD                | 78,000                 | SUPERIOR PLUS 4.5000% 15/03/29 144A | 80,535    | 0.05     |
| USD                | 77,000                 | 1011778 BC UL 3.5000% 15/02/29 144A | 76,423    | 0.05     |
| USD                | 57,000                 | AUTOMATION TO 4.1250% 15/12/28 144A | 58,425    | 0.04     |
| USD                | 32,000                 | MEG ENERGY CO 6.5000% 15/01/25 144A | 32,960    | 0.02     |
| USD                | 24,000                 | PRECISION DRI 6.8750% 15/01/29 144A | 24,962    | 0.02     |
|                    |                        |                                     | 8,997,125 | 5.83     |
|                    |                        | カナダ計                                | 8,997,125 | 5.83     |

| 通貨             | 種類 / 額面 <sup>(1)</sup> | 銘柄                                  | 評価額       | 純資産比率(%) |
|----------------|------------------------|-------------------------------------|-----------|----------|
| <b>ケイマン諸島</b>  |                        |                                     |           |          |
| その他債券          |                        |                                     |           |          |
| USD            | 555,000                | TRANSOCEAN 6.1250% 01/08/25 144A    | 371,850   | 0.24     |
|                |                        |                                     | 371,850   | 0.24     |
|                |                        | ケイマン諸島計                             | 371,850   | 0.24     |
| <b>フランス</b>    |                        |                                     |           |          |
| 普通社債(固定金利債)    |                        |                                     |           |          |
| USD            | 586,000                | ALTICE FRANCE 8.1250% 01/02/27 144A | 630,829   | 0.41     |
| USD            | 390,000                | NUMERICABLE SFR 7.375% 01/05/26 144 | 404,742   | 0.26     |
| USD            | 308,000                | ALTICE FRANCE 5.1250% 15/07/29 144A | 300,300   | 0.19     |
| USD            | 200,000                | ALTICE FRANCE 5.5000% 15/10/29 144A | 198,666   | 0.13     |
|                |                        |                                     | 1,534,537 | 0.99     |
|                |                        | フランス計                               | 1,534,537 | 0.99     |
| <b>アイルランド</b>  |                        |                                     |           |          |
| 普通社債(固定金利債)    |                        |                                     |           |          |
| USD            | 800,000                | ARDAGH PKG FI 4.1250% 15/08/26 144A | 828,000   | 0.54     |
| USD            | 200,000                | JAZZ SECURITI 4.3750% 15/01/29 144A | 207,500   | 0.13     |
|                |                        |                                     | 1,035,500 | 0.67     |
|                |                        | アイルランド計                             | 1,035,500 | 0.67     |
| <b>ジャージー</b>   |                        |                                     |           |          |
| 普通社債(固定金利債)    |                        |                                     |           |          |
| USD            | 230,000                | ADIANT GLOBAL 4.8750% 15/08/26 144A | 235,750   | 0.15     |
|                |                        |                                     | 235,750   | 0.15     |
|                |                        | ジャージー計                              | 235,750   | 0.15     |
| <b>リベリア</b>    |                        |                                     |           |          |
| 普通社債(固定金利債)    |                        |                                     |           |          |
| USD            | 45,000                 | ROYAL CARIBBE 9.1250% 15/06/23 144A | 48,825    | 0.03     |
|                |                        |                                     | 48,825    | 0.03     |
|                |                        | リベリア計                               | 48,825    | 0.03     |
| <b>ルクセンブルグ</b> |                        |                                     |           |          |
| 普通社債(固定金利債)    |                        |                                     |           |          |
| USD            | 648,000                | TR OP / TR FI 5.3750% 01/09/25 144A | 657,720   | 0.42     |
| USD            | 424,000                | TELECOM IT CAP 6.3750% 15/11/33     | 492,773   | 0.32     |
| USD            | 215,000                | ALTICE FINANC 5.7500% 15/08/29 144A | 211,775   | 0.14     |
| USD            | 134,000                | TR OP / TR FI 5.1250% 01/04/29 144A | 135,340   | 0.09     |
| USD            | 100,000                | ENDO LUX FIN 6.1250% 01/04/29 144A  | 99,500    | 0.06     |
|                |                        |                                     | 1,597,108 | 1.03     |
|                |                        | ルクセンブルグ計                            | 1,597,108 | 1.03     |
| <b>オランダ</b>    |                        |                                     |           |          |
| 普通社債(固定金利債)    |                        |                                     |           |          |
| USD            | 313,000                | SENSATA TECHNO 4.875% 15/10/23 144A | 332,953   | 0.22     |
| USD            | 200,000                | ALCOA NEDERLA 5.5000% 15/12/27 144A | 214,500   | 0.14     |
| USD            | 200,000                | TRIVIUM PACK 5.5000% 15/08/26 144A  | 210,082   | 0.14     |
| USD            | 200,000                | UPC BROAD FIN 4.8750% 15/07/31 144A | 205,250   | 0.13     |

| 通貨          | 種類 / 額面 <sup>(1)</sup> | 銘柄                                  | 評価額       | 純資産比率(%) |
|-------------|------------------------|-------------------------------------|-----------|----------|
| USD         | 171,000                | SENSATA TECH 4.0000% 15/04/29 144A  | 174,634   | 0.11     |
| USD         | 125,000                | SENSATA TECHNO 5% 01/10/25 144A     | 138,013   | 0.09     |
|             |                        |                                     | 1,275,432 | 0.83     |
|             |                        | オランダ計                               | 1,275,432 | 0.83     |
|             |                        | パナマ                                 |           |          |
| 普通社債(固定金利債) |                        |                                     |           |          |
| USD         | 154,000                | CARNIVAL CORP 4.0000% 01/08/28 144A | 155,523   | 0.10     |
| USD         | 76,000                 | CARNIVAL COR 10.5000% 01/02/26 144A | 88,041    | 0.06     |
|             |                        |                                     | 243,564   | 0.16     |
|             |                        | パナマ計                                | 243,564   | 0.16     |
|             |                        | イギリス                                |           |          |
| 変動金利債       |                        |                                     |           |          |
| USD         | 250,000                | BARCLAYS PLC FRN 15/09/69           | 282,500   | 0.18     |
| USD         | 214,000                | BARCLAYS PLC FRN 15/12/69           | 233,260   | 0.15     |
|             |                        |                                     | 515,760   | 0.33     |
|             |                        | イギリス計                               | 515,760   | 0.33     |
|             |                        | アメリカ                                |           |          |
| 変動金利債       |                        |                                     |           |          |
| USD         | 417,000                | BANK OF AMERICA FRN 29/12/49 AA     | 466,463   | 0.30     |
| USD         | 530,000                | ILFC E-CAP TRUST FRN 21/12/65 144A  | 442,349   | 0.29     |
| USD         | 240,000                | CITIGROUP INC FRN 29/12/49 T        | 280,550   | 0.18     |
| USD         | 255,000                | CITIGROUP INC FRN 15/11/69 P        | 278,269   | 0.18     |
| USD         | 218,000                | ENLINK MIDSTREAM FRN 15/12/69 C     | 166,737   | 0.11     |
| USD         | 52,000                 | VIACOM INC FRN 28/02/57             | 59,540    | 0.04     |
|             |                        |                                     | 1,693,908 | 1.10     |
| その他債券       |                        |                                     |           |          |
| USD         | 274,000                | AMERICAN AIRL 5.5000% 20/04/26 144A | 287,765   | 0.18     |
| USD         | 237,250                | AMERICAN AIRL 5.7500% 20/04/29 144A | 255,637   | 0.17     |
| USD         | 99,000                 | LIBERTY MEDIA CV 4.0000% 15/11/29   | 75,608    | 0.05     |
| USD         | 71,000                 | LIBERTY MEDIA CV 3.7500% 15/02/30   | 54,590    | 0.04     |
|             |                        |                                     | 673,600   | 0.44     |
| 普通社債(固定金利債) |                        |                                     |           |          |
| USD         | 1,912,000              | HCA INC 5.875% 15/02/26             | 2,201,667 | 1.42     |
| USD         | 1,707,000              | DISH DBS CORP 5.875% 15/11/24       | 1,834,785 | 1.18     |
| USD         | 1,415,000              | SPRINT CORP 7.625% 15/02/25         | 1,655,549 | 1.06     |
| USD         | 1,296,000              | CENTENE CORP 4.6250% 15/12/29 WI    | 1,409,399 | 0.90     |
| USD         | 1,326,000              | CCO HOLDINGS 4.7500% 01/03/30 144A  | 1,388,984 | 0.89     |
| USD         | 1,304,000              | CLEAR CHNL WO 5.1250% 15/08/27 144A | 1,346,366 | 0.86     |
| USD         | 1,220,000              | TENET HEALTHC 7.5000% 01/04/25 144A | 1,297,774 | 0.83     |
| USD         | 1,205,000              | CCO HOLDINGS 5.0000% 01/02/28 144A  | 1,257,929 | 0.80     |
| USD         | 800,000                | SPRINT CAP CORP 8.7500% 15/03/32    | 1,199,171 | 0.78     |
| USD         | 1,095,000              | CSC HOLDINGS 6.5000% 01/02/29 144A  | 1,188,074 | 0.77     |
| USD         | 1,083,000              | LEVEL 3 FIN INC 5.25% 15/3/26 WI    | 1,117,655 | 0.72     |
| USD         | 1,000,000              | HCA INC 5.375% 01/02/25             | 1,116,249 | 0.72     |
| USD         | 1,010,000              | UNITED RENTAL NA 5.2500% 15/01/30   | 1,104,687 | 0.72     |
| USD         | 850,000                | SPRINT CORP 7.125% 15/06/24 WI      | 967,894   | 0.63     |
| USD         | 890,000                | PHOTO HOLDING 8.5000% 01/10/26 144A | 961,199   | 0.62     |
| USD         | 950,000                | FORD MOTOR CRED 5.5960% 07/01/22    | 960,734   | 0.62     |

| 通貨  | 種類 / 額面 <sup>(1)</sup> | 銘柄                                  | 評価額     | 純資産比率(%) |
|-----|------------------------|-------------------------------------|---------|----------|
| USD | 934,000                | STAPLES INC 7.5000% 15/04/26 144A   | 949,177 | 0.61     |
| USD | 896,000                | NEXSTAR ESCRO 5.6250% 15/07/27 144A | 947,196 | 0.61     |
| USD | 852,000                | ALBERTSONS CO 7.5000% 15/03/26 144A | 922,289 | 0.60     |
| USD | 913,000                | BWAY HDGS CO 5.5% 15/04/24 144A     | 920,988 | 0.60     |
| USD | 856,000                | NCR CORP 5.7500% 01/09/27 144A      | 905,219 | 0.59     |
| USD | 835,000                | FORD MOTOR CRED 4.5420% 01/08/26    | 902,843 | 0.58     |
| USD | 845,000                | CCO HDG LLC/CAP 5.125% 01/05/27 144 | 879,331 | 0.57     |
| USD | 830,000                | POST HLDGS 5.75% 01/03/27 144A      | 861,124 | 0.56     |
| USD | 810,000                | DIAMOND 1/2 FIN 7.125% 15/06/24 144 | 828,070 | 0.54     |
| USD | 720,000                | HCA INC 5.3750% 01/09/26            | 824,399 | 0.53     |
| USD | 769,000                | SS&C TECH INC 5.5000% 30/09/27 144A | 812,255 | 0.53     |
| USD | 750,000                | IHEARTCOMMUNICAT 6.3750% 01/05/26   | 789,374 | 0.51     |
| USD | 629,000                | MGM GROWTH/MGM 5.7500% 01/02/27 WI  | 722,946 | 0.47     |
| USD | 703,000                | VISTA OUTDOOR 4.5000% 15/03/29 144A | 718,817 | 0.47     |
| USD | 665,000                | ENCOMPASS HLTH 4.5000% 01/02/28     | 687,443 | 0.45     |
| USD | 636,000                | BRINK'S CO/TH 4.6250% 15/10/27 144A | 663,331 | 0.43     |
| USD | 614,000                | NRG ENERGY IN 5.2500% 15/06/29 144A | 657,008 | 0.43     |
| USD | 675,000                | DAVITA INC 3.7500% 15/02/31 144A    | 656,744 | 0.43     |
| USD | 575,000                | DISH DBS CORP 7.75% 01/07/26        | 649,749 | 0.42     |
| USD | 625,000                | LIVE NATION E 4.7500% 15/10/27 144A | 635,093 | 0.41     |
| USD | 597,000                | AMER AXLE & MFG 6.8750% 01/07/28    | 634,168 | 0.41     |
| USD | 580,000                | DANA INC 5.3750% 15/11/27           | 611,899 | 0.40     |
| USD | 575,000                | TARGA RES PRTRNS 5.8750% 15/04/26   | 600,515 | 0.39     |
| USD | 595,000                | ADT CORP 4.8750% 15/07/32 144A      | 597,974 | 0.39     |
| USD | 509,000                | NETFLIX INC 4.8750% 15/04/28 144A   | 587,105 | 0.38     |
| USD | 553,000                | IMOLA MERGER 4.7500% 15/05/29 144A  | 570,972 | 0.37     |
| USD | 537,000                | NUANCE COMMUNIC 5.6250% 15/12/26    | 555,795 | 0.36     |
| USD | 442,000                | OCCIDENTAL PETE 8.5000% 15/07/27    | 554,078 | 0.36     |
| USD | 445,000                | NETFLIX INC 5.8750% 15/11/28        | 544,013 | 0.35     |
| USD | 399,000                | OCCIDENTAL PETE 8.8750% 15/07/30    | 542,640 | 0.35     |
| USD | 532,000                | CCO HOLDINGS 4.2500% 01/02/31 144A  | 541,310 | 0.35     |
| USD | 490,000                | LIVE NATION E 6.5000% 15/05/27 144A | 537,775 | 0.35     |
| USD | 516,000                | IRON MOUNTAIN 4.8750% 15/09/27 144A | 534,705 | 0.35     |
| USD | 485,000                | MGM RESORTS 5.5000% 15/04/27        | 528,650 | 0.34     |
| USD | 490,000                | MEREDITH CORP 6.5000% 01/07/25      | 526,422 | 0.34     |
| USD | 497,000                | TENET HEALTHC 6.2500% 01/02/27 144A | 516,495 | 0.33     |
| USD | 493,000                | FRONTIER COMM 5.0000% 01/05/28 144A | 515,855 | 0.33     |
| USD | 486,000                | SIRIUS XM RAD 5.0000% 01/08/27 144A | 508,721 | 0.33     |
| USD | 479,000                | CENTENE CORP 4.2500% 15/12/27 WI    | 502,006 | 0.33     |
| USD | 471,000                | VICI PROPERTI 4.2500% 01/12/26 144A | 492,289 | 0.32     |
| USD | 467,000                | VAIL RESORTS 6.2500% 15/05/25 144A  | 492,101 | 0.32     |
| USD | 450,000                | RANGE RESOURCES 9.2500% 01/02/26 WI | 489,825 | 0.32     |
| USD | 448,000                | SIRIUS XM RAD 5.5000% 01/07/29 144A | 485,531 | 0.31     |
| USD | 448,000                | VICI PROPERTI 4.6250% 01/12/29 144A | 485,498 | 0.31     |
| USD | 443,000                | CDK GLOBAL IN 5.2500% 15/05/29 144A | 480,101 | 0.31     |
| USD | 445,000                | EMBARQ CORP 7.995% 01/06/36         | 477,263 | 0.31     |
| USD | 450,000                | GRIFFON CORP 5.7500% 01/03/28 WI    | 474,750 | 0.31     |
| USD | 465,000                | STATION CAS 4.5000% 15/02/28 144A   | 473,138 | 0.31     |
| USD | 460,000                | CENTURYTEL IN 4.0000% 15/02/27 144A | 469,775 | 0.30     |
| USD | 445,000                | ENTEGRIS INC 4.3750% 15/04/28 144A  | 466,138 | 0.30     |
| USD | 444,000                | VISTRA OPERAT 5.6250% 15/02/27 144A | 459,540 | 0.30     |

| 通貨  | 種類 / 額面 <sup>(1)</sup> | 銘柄                                   | 評価額     | 純資産比率(%) |
|-----|------------------------|--------------------------------------|---------|----------|
| USD | 430,000                | CINC BELL INC 8.0000% 15/10/25 144A  | 448,146 | 0.29     |
| USD | 405,000                | COOPER-STAND 13.0000% 01/06/24 144A  | 445,500 | 0.29     |
| USD | 421,000                | TENET HEALTHC 5.1250% 01/11/27 144A  | 440,998 | 0.29     |
| USD | 415,000                | CHENIERE ENERGY 4.6250% 15/10/28 WI  | 436,933 | 0.28     |
| USD | 418,000                | MEREDITH CORP 6.8750% 01/02/26       | 431,585 | 0.28     |
| USD | 415,000                | CENTURYLINK I 5.1250% 15/12/26 144A  | 430,563 | 0.28     |
| USD | 335,000                | SPRINT CAP CORP 6.875% 15/11/28      | 427,963 | 0.28     |
| USD | 417,000                | TENET HEALTHC 4.6250% 15/07/24 144A  | 423,255 | 0.27     |
| USD | 405,000                | LABL ESCROW I 6.7500% 15/07/26 144A  | 423,225 | 0.27     |
| USD | 380,000                | NEWELL RUBBERMAID INC 4.2% 01/04/26  | 420,410 | 0.27     |
| USD | 405,000                | ARAMARK SERV 5.0000% 01/02/28 144A   | 417,150 | 0.27     |
| USD | 400,000                | JELD-WEN INC 4.8750% 15/12/27 144A   | 416,000 | 0.27     |
| USD | 401,000                | CENTRAL GARDEN 4.1250% 15/10/30      | 412,108 | 0.27     |
| USD | 389,000                | AVANTOR FUNDI 4.6250% 15/07/28 144A  | 409,909 | 0.27     |
| USD | 375,000                | TALLGRASS NRG 7.5000% 01/10/25 144A  | 405,469 | 0.26     |
| USD | 396,000                | WYNN LAS VEGAS 5.5% 01/03/25 144A    | 405,393 | 0.26     |
| USD | 392,000                | LAMB WESTON 4.875% 01/11/26 144A     | 402,184 | 0.26     |
| USD | 355,000                | SOUTHWESTERN ENE 8.3750% 15/09/28    | 401,150 | 0.26     |
| USD | 436,000                | WOLVERINE ESC 9.0000% 15/11/26 144A  | 401,120 | 0.26     |
| USD | 378,000                | FREEPORT-MCMORAN 4.3750% 01/08/28    | 395,123 | 0.26     |
| USD | 384,000                | B&G FOODS INC 5.25% 01/04/25         | 393,120 | 0.25     |
| USD | 370,000                | MASTEC INC 4.5000% 15/08/28 144A     | 385,725 | 0.25     |
| USD | 355,000                | TARGA RES PRTNRS 6.5000% 15/07/27    | 382,513 | 0.25     |
| USD | 370,000                | ORGANON & CO/ 4.1250% 30/04/28 144A  | 378,270 | 0.25     |
| USD | 360,000                | EDGEWELL PERS 5.5000% 01/06/28 144A  | 378,000 | 0.24     |
| USD | 365,000                | TELEFLEX INC 4.2500% 01/06/28 144A   | 377,319 | 0.24     |
| USD | 378,000                | ENERGIZER HLD 4.3750% 31/03/29 144A  | 375,165 | 0.24     |
| USD | 359,000                | RHP HOTEL PPTY 4.7500% 15/10/27      | 372,534 | 0.24     |
| USD | 358,000                | ON SEMICONDUCT 3.8750% 01/09/28 144A | 369,309 | 0.24     |
| USD | 353,000                | DIRECTV HLDGS 5.8750% 15/08/27 144A  | 368,673 | 0.24     |
| USD | 374,000                | WMG ACQUISITI 3.0000% 15/02/31 144A  | 365,118 | 0.24     |
| USD | 364,000                | HOLOGIC INC 3.2500% 15/02/29 144A    | 364,724 | 0.24     |
| USD | 350,000                | AXALTA COAT/B 4.7500% 15/06/27 144A  | 364,424 | 0.24     |
| USD | 335,000                | HEXION INC 7.8750% 15/07/27 144A     | 358,450 | 0.23     |
| USD | 345,000                | DISH DBS CORP 5% 15/03/23            | 358,369 | 0.23     |
| USD | 341,000                | COMMScope FIN 6.0000% 01/03/26 144A  | 355,654 | 0.23     |
| USD | 341,000                | ALLISON TRANS 4.7500% 01/10/27 144A  | 355,066 | 0.23     |
| USD | 292,000                | NETFLIX INC 5.3750% 15/11/29 144A    | 353,320 | 0.23     |
| USD | 332,000                | GOODYEAR TIRE 5.0000% 15/07/29 144A  | 352,750 | 0.23     |
| USD | 339,000                | TARGA RES PRT 4.0000% 15/01/32 144A  | 350,865 | 0.23     |
| USD | 297,000                | HOWMET AEROSPACE 5.9000% 01/02/27    | 348,233 | 0.23     |
| USD | 347,000                | ALBERTSONS CO 3.5000% 15/03/29 144A  | 346,133 | 0.22     |
| USD | 329,000                | HERC HOLDINGS 5.5000% 15/07/27 144A  | 344,628 | 0.22     |
| USD | 330,000                | PG&E CORP 5.0000% 01/07/28           | 335,363 | 0.22     |
| USD | 315,000                | FORD MOTOR CRED 4.2710% 09/01/27     | 335,081 | 0.22     |
| USD | 305,000                | EQM MIDSTREAM 6.0000% 01/07/25 144A  | 334,448 | 0.22     |
| USD | 341,000                | STAPLES INC 10.7500% 15/04/27 144A   | 332,049 | 0.22     |
| USD | 321,000                | FREEPORT-MCMORAN 4.1250% 01/03/28    | 331,147 | 0.21     |
| USD | 345,000                | PRIME SEC/FIN 3.3750% 31/08/27 144A  | 330,597 | 0.21     |
| USD | 296,000                | WESCO DISTRIB 7.2500% 15/06/28 144A  | 328,492 | 0.21     |
| USD | 320,000                | RBS GLOBAL/RE 4.8750% 15/12/25 144A  | 327,840 | 0.21     |

| 通貨  | 種類 / 額面 <sup>(1)</sup> | 銘柄                                  | 評価額     | 純資産比率(%) |
|-----|------------------------|-------------------------------------|---------|----------|
| USD | 315,000                | ANTERO MIDSTR 5.7500% 15/01/28 144A | 326,419 | 0.21     |
| USD | 308,000                | COMMScope FIN 8.2500% 01/03/27 144A | 322,624 | 0.21     |
| USD | 308,000                | TEMPUR SEALY 4.0000% 15/04/29 144A  | 318,281 | 0.21     |
| USD | 314,000                | WYNN RESORTS 5.1250% 01/10/29 144A  | 317,140 | 0.21     |
| USD | 296,000                | WESCO DISTRIB 7.1250% 15/06/25 144A | 317,128 | 0.21     |
| USD | 304,000                | CDW LLC/CDW FIN 4.2500% 01/04/28    | 317,075 | 0.21     |
| USD | 308,000                | HILTON WORLDWIDE 4.8750% 01/04/27   | 316,773 | 0.21     |
| USD | 295,000                | FORD MOTOR CRED 4.6870% 09/06/25    | 316,019 | 0.20     |
| USD | 315,000                | ACCO BRANDS C 4.2500% 15/03/29 144A | 314,606 | 0.20     |
| USD | 300,000                | CHEMOURS CO 5.7500% 15/11/28 144A   | 313,875 | 0.20     |
| USD | 295,000                | SABRE GLBL IN 7.3750% 01/09/25 144A | 313,069 | 0.20     |
| USD | 280,000                | LIBERTY MEDIA 8.2500% 01/02/30      | 311,276 | 0.20     |
| USD | 299,000                | ENCINO ACQUIS 8.5000% 01/05/28 144A | 307,223 | 0.20     |
| USD | 247,000                | US CELLULAR 6.7000% 15/12/33        | 305,045 | 0.20     |
| USD | 274,000                | CENTURYLINK INC 7.5% 01/04/24 Y     | 304,483 | 0.20     |
| USD | 280,000                | LAMAR MEDIA CORP 4.8750% 15/01/29   | 296,800 | 0.19     |
| USD | 280,000                | HILL-ROM HLDG 4.3750% 15/09/27 144A | 292,600 | 0.19     |
| USD | 286,000                | CRESTWOOD MID PA 5.7500% 01/04/25   | 292,435 | 0.19     |
| USD | 282,000                | HILTON GRAND VA 6.1250% 01/12/24 WI | 291,955 | 0.19     |
| USD | 268,000                | VINE ENERGY H 6.7500% 15/04/29 144A | 289,775 | 0.19     |
| USD | 275,000                | GCI LLC 4.7500% 15/10/28 144A       | 289,438 | 0.19     |
| USD | 288,000                | ZAYO GROUP HO 4.0000% 01/03/27 144A | 286,920 | 0.19     |
| USD | 275,000                | STANDARD INDS 4.7500% 15/01/28 144A | 286,344 | 0.19     |
| USD | 270,000                | FORD MOTOR CRED 4.1250% 17/08/27    | 286,200 | 0.19     |
| USD | 270,000                | FORD MOTOR CRED 4.1340% 04/08/25    | 286,123 | 0.19     |
| USD | 285,000                | RHP HOTEL PPT 4.5000% 15/02/29 144A | 285,713 | 0.19     |
| USD | 267,000                | GRAY TELE INC 7.0000% 15/05/27 144A | 285,690 | 0.19     |
| USD | 270,000                | NOVELIS CORP 4.7500% 30/01/30 144A  | 284,155 | 0.18     |
| USD | 272,000                | IQVIA INC 5.0000% 15/05/27 144A     | 281,520 | 0.18     |
| USD | 270,000                | HESS MIDSTREA 5.1250% 15/06/28 144A | 280,800 | 0.18     |
| USD | 275,000                | ENERGIZER HLD 4.7500% 15/06/28 144A | 279,125 | 0.18     |
| USD | 266,000                | GREIF INC 6.5000% 01/03/27 144A     | 277,970 | 0.18     |
| USD | 260,000                | ALBERTSONS CO 4.6250% 15/01/27 144A | 273,000 | 0.18     |
| USD | 265,000                | AVIS BUDGET C 4.7500% 01/04/28 144A | 272,288 | 0.18     |
| USD | 239,000                | CENTURY TEL ENTP 6.8750% 15/01/28 G | 271,863 | 0.18     |
| USD | 273,000                | PACTIV EVERGR 4.0000% 15/10/27 144A | 270,270 | 0.18     |
| USD | 190,000                | FORD MOTOR CO 9.6250% 22/04/30      | 269,463 | 0.17     |
| USD | 247,000                | YUM! BRANDS I 4.7500% 15/01/30 144A | 268,613 | 0.17     |
| USD | 205,000                | DCP MIDSTREAM 6.75% 15/09/37        | 264,450 | 0.17     |
| USD | 245,000                | OWENS-BROCKWA 6.6250% 13/05/27 144A | 263,375 | 0.17     |
| USD | 219,000                | OCCIDENTAL PETE 8.0000% 15/07/25    | 262,253 | 0.17     |
| USD | 250,000                | PETSMART INC/ 4.7500% 15/02/28 144A | 258,305 | 0.17     |
| USD | 242,000                | SPIRIT AEROSY 7.5000% 15/04/25 144A | 256,290 | 0.17     |
| USD | 245,000                | DOWNSTREAM D 10.5000% 15/02/23 144A | 256,025 | 0.17     |
| USD | 243,000                | ARCONIC CORP 6.0000% 15/05/25 144A  | 254,846 | 0.17     |
| USD | 246,000                | CCO HLDGS LLC/CAP 5.5% 01/05/26 144 | 254,303 | 0.16     |
| USD | 240,000                | CALIFORNIA RE 7.1250% 01/02/26 144A | 252,900 | 0.16     |
| USD | 245,000                | GRAY TELE INC 5.875% 15/07/26 144A  | 252,773 | 0.16     |
| USD | 239,000                | CD&R SMOKEY B 6.7500% 15/07/25 144A | 252,743 | 0.16     |
| USD | 238,000                | ARCONIC ROLLE 6.1250% 15/02/28 144A | 250,793 | 0.16     |
| USD | 235,000                | NUSTAR LOGISTICS 5.625% 28/04/27    | 250,566 | 0.16     |

| 通貨  | 種類 / 額面 <sup>(1)</sup> | 銘柄                                  | 評価額     | 純資産比率(%) |
|-----|------------------------|-------------------------------------|---------|----------|
| USD | 235,000                | JELD-WEN INC 6.2500% 15/05/25 144A  | 247,925 | 0.16     |
| USD | 242,000                | ENTERCOM MEDI 6.5000% 01/05/27 144A | 246,840 | 0.16     |
| USD | 217,000                | AMERIGAS FIN 5.875% 20/08/26        | 245,210 | 0.16     |
| USD | 243,000                | GENESIS ENERGY 7.7500% 01/02/28     | 242,393 | 0.16     |
| USD | 230,000                | VERTICAL US N 5.2500% 15/07/27 144A | 242,075 | 0.16     |
| USD | 195,000                | NEWELL RUBBERMAI 5.8750% 01/04/36   | 241,800 | 0.16     |
| USD | 226,000                | HILTON DOMESTIC 4.8750% 15/01/30 WI | 241,662 | 0.16     |
| USD | 240,000                | DYCOM INDS 4.5000% 15/04/29 144A    | 240,900 | 0.16     |
| USD | 228,000                | ORGANON & CO/ 5.1250% 30/04/31 144A | 239,685 | 0.16     |
| USD | 240,000                | CCO HOLDINGS 4.2500% 15/01/34 144A  | 238,800 | 0.15     |
| USD | 198,000                | OCCIDENTAL PETE 6.1250% 01/01/31    | 238,586 | 0.15     |
| USD | 214,000                | SPECTRUM BRAN 5.5000% 15/07/30 144A | 235,935 | 0.15     |
| USD | 225,000                | BUCKEYE PARTN 4.1250% 01/03/25 144A | 232,875 | 0.15     |
| USD | 229,000                | STATION CASIN 5.0000% 01/10/25 144A | 232,830 | 0.15     |
| USD | 225,000                | GLOBAL MEDICA 6.5000% 01/10/25 144A | 232,380 | 0.15     |
| USD | 225,000                | ENLINK MIDSTREAM 4.1500% 01/06/25   | 232,216 | 0.15     |
| USD | 221,000                | AMER AXLE & MFG 6.5000% 01/04/27    | 230,242 | 0.15     |
| USD | 220,000                | ACI WORLDWIDE 5.7500% 15/08/26 144A | 229,900 | 0.15     |
| USD | 225,000                | BUCKEYE PARTN 4.5000% 01/03/28 144A | 228,938 | 0.15     |
| USD | 220,000                | EQM MIDSTREAM 4.5000% 15/01/29 144A | 228,250 | 0.15     |
| USD | 231,000                | FRST STU BIDC 4.0000% 31/07/29 144A | 227,034 | 0.15     |
| USD | 220,000                | OCCIDENTAL PETE 3.4000% 15/04/26    | 226,600 | 0.15     |
| USD | 225,000                | COMMScope INC 4.7500% 01/09/29 144A | 225,281 | 0.15     |
| USD | 219,000                | UNITED AIRLIN 4.3750% 15/04/26 144A | 224,749 | 0.15     |
| USD | 216,000                | ENLINK MIDSTREAM 4.4% 01/04/24      | 224,502 | 0.15     |
| USD | 207,000                | SOUTHWESTERN ENE 5.3750% 15/03/30   | 223,560 | 0.14     |
| USD | 220,000                | IRON MOUNTAIN 4.5000% 15/02/31 144A | 223,535 | 0.14     |
| USD | 215,000                | NEXSTAR BROAD 4.7500% 01/11/28 144A | 223,063 | 0.14     |
| USD | 217,000                | BWX TECHNOLOG 4.1250% 15/04/29 144A | 222,696 | 0.14     |
| USD | 225,000                | CSC HOLDINGS 4.5000% 15/11/31 144A  | 222,188 | 0.14     |
| USD | 225,000                | SINCLAIR TELE 4.1250% 01/12/30 144A | 219,938 | 0.14     |
| USD | 209,000                | TRANSDIGM INC 6.2500% 15/03/26 144A | 218,405 | 0.14     |
| USD | 200,000                | MATTEL INC 5.8750% 15/12/27 144A    | 216,500 | 0.14     |
| USD | 212,000                | CORECIVIC INC 8.2500% 15/04/26      | 216,240 | 0.14     |
| USD | 210,000                | UNITED RENTAL NA 3.8750% 15/02/31   | 214,988 | 0.14     |
| USD | 209,000                | SRS DISTRIBUT 4.6250% 01/07/28 144A | 213,571 | 0.14     |
| USD | 205,000                | SCOTTS MIRACLE 4.5000% 15/10/29     | 213,456 | 0.14     |
| USD | 205,000                | PERFORMANCE F 5.5000% 15/10/27 144A | 213,200 | 0.14     |
| USD | 215,000                | ADT SEC CORP 4.1250% 01/08/29 144A  | 213,065 | 0.14     |
| USD | 170,000                | L BRANDS 6.75% 01/07/36             | 211,832 | 0.14     |
| USD | 200,000                | MARRIOTT OWNE 6.1250% 15/09/25 144A | 211,250 | 0.14     |
| USD | 203,000                | IHEARTCOMMUNI 5.2500% 15/08/27 144A | 211,120 | 0.14     |
| USD | 175,000                | FORD MOTOR CO 9.0000% 22/04/25      | 210,984 | 0.14     |
| USD | 205,000                | SM ENERGY CO 6.75% 15/09/26         | 209,572 | 0.14     |
| USD | 207,000                | TALLGRASS NRG 6.0000% 01/09/31 144A | 208,810 | 0.14     |
| USD | 185,000                | SPRINGLEAF FINANCE 6.8750% 15/03/25 | 208,125 | 0.13     |
| USD | 200,000                | FORD MOTOR CRED 4.0000% 13/11/30    | 208,000 | 0.13     |
| USD | 202,000                | LUMEN TECH IN 5.3750% 15/06/29 144A | 207,050 | 0.13     |
| USD | 200,000                | FORD MOTOR CRED 3.3750% 13/11/25    | 206,416 | 0.13     |
| USD | 198,000                | OASIS MIDSTRE 8.0000% 01/04/29 144A | 205,920 | 0.13     |
| USD | 200,000                | IQVIA INC 5.0000% 15/10/26 144A     | 205,250 | 0.13     |

| 通貨  | 種類 / 額面 <sup>(1)</sup> | 銘柄                                  | 評価額     | 純資産比率(%) |
|-----|------------------------|-------------------------------------|---------|----------|
| USD | 201,000                | OCEANEERING INTL 6.0000% 01/02/28   | 204,518 | 0.13     |
| USD | 199,000                | COMMScope TECH FIN 6% 15/06/25 144A | 201,488 | 0.13     |
| USD | 196,000                | CINCINNATI BELL 7% 15/07/24 144A    | 199,675 | 0.13     |
| USD | 195,000                | BOOZ ALLEN & 3.8750% 01/09/28 144A  | 199,664 | 0.13     |
| USD | 200,000                | MADISON IAQ L 4.1250% 30/06/28 144A | 199,500 | 0.13     |
| USD | 200,000                | ATLAS LUXCO 4 4.6250% 01/06/28 144A | 199,000 | 0.13     |
| USD | 200,000                | OLYMPUS WTR H 4.2500% 01/10/28 144A | 197,000 | 0.13     |
| USD | 196,000                | BLACK KNIGHT 3.6250% 01/09/28 144A  | 196,980 | 0.13     |
| USD | 200,000                | MAV ACQUISITI 5.7500% 01/08/28 144A | 196,500 | 0.13     |
| USD | 191,000                | TRIMAS CORP 4.1250% 15/04/29 144A   | 196,224 | 0.13     |
| USD | 189,000                | MIDCONTINENT 5.3750% 15/08/27 144A  | 196,088 | 0.13     |
| USD | 181,000                | COMSTOCK RE I 6.7500% 01/03/29 144A | 195,254 | 0.13     |
| USD | 194,000                | STERICYCLE IN 3.8750% 15/01/29 144A | 195,046 | 0.13     |
| USD | 195,000                | PERFORMANCE F 4.2500% 01/08/29 144A | 194,756 | 0.13     |
| USD | 184,000                | PM GENERAL PU 9.5000% 01/10/28 144A | 194,414 | 0.13     |
| USD | 183,000                | ALLEGHENY TECH 5.8750% 01/12/27     | 194,322 | 0.13     |
| USD | 183,000                | MGM GROWTH/MG 3.8750% 15/02/29 144A | 193,980 | 0.13     |
| USD | 190,000                | HOLLY PAR/FIN 5.0000% 01/02/28 144A | 192,660 | 0.12     |
| USD | 175,000                | FORD MOTOR CO 8.5000% 21/04/23      | 192,047 | 0.12     |
| USD | 190,000                | UBER TECHNOLO 4.5000% 15/08/29 144A | 191,425 | 0.12     |
| USD | 187,000                | YUM! BRANDS INC 3.6250% 15/03/31    | 189,338 | 0.12     |
| USD | 187,000                | ELEMENT SOLN 3.8750% 01/09/28 144A  | 188,870 | 0.12     |
| USD | 184,000                | ALBERTSONS CO 3.2500% 15/03/26 144A | 186,530 | 0.12     |
| USD | 173,000                | YUM! BRANDS INC 4.6250% 31/01/32    | 184,245 | 0.12     |
| USD | 225,000                | COOPER STANDARD 5.625% 15/11/26     | 183,903 | 0.12     |
| USD | 175,000                | POST HOLDINGS 5.6250% 15/01/28 144A | 183,663 | 0.12     |
| USD | 173,000                | FRONTIER COMM 5.8750% 15/10/27 144A | 183,380 | 0.12     |
| USD | 167,000                | MGM RESORTS 5.7500% 15/06/25        | 182,808 | 0.12     |
| USD | 182,000                | SCOTTS MIRACL 4.0000% 01/04/31 144A | 182,091 | 0.12     |
| USD | 166,000                | BLUE RACER MI 7.6250% 15/12/25 144A | 179,695 | 0.12     |
| USD | 184,000                | EMERGENT BIOS 3.8750% 15/08/28 144A | 179,179 | 0.12     |
| USD | 270,000                | DIAMOND SPORT 5.3750% 15/08/26 144A | 178,840 | 0.12     |
| USD | 173,000                | LIVE NATION E 5.6250% 15/03/26 144A | 178,839 | 0.12     |
| USD | 188,000                | PLANTRONICS I 4.7500% 01/03/29 144A | 177,745 | 0.12     |
| USD | 153,000                | SABRE GLBL IN 9.2500% 15/04/25 144A | 176,333 | 0.11     |
| USD | 180,000                | GENESIS ENERGY 6.2500% 15/05/26     | 176,175 | 0.11     |
| USD | 171,000                | PAR PHARMA IN 7.5000% 01/04/27 144A | 174,206 | 0.11     |
| USD | 168,000                | NATIONSTAR MT 5.5000% 15/08/28 144A | 173,040 | 0.11     |
| USD | 165,000                | AVIS BUDGET C 5.7500% 15/07/27 144A | 172,013 | 0.11     |
| USD | 165,000                | EQM MIDSTREAM 4.7500% 15/01/31 144A | 171,600 | 0.11     |
| USD | 160,000                | VALEANT PHARM 9.2500% 01/04/26 144A | 170,800 | 0.11     |
| USD | 162,000                | JB POINDEXTER 7.1250% 15/04/26 144A | 170,505 | 0.11     |
| USD | 167,000                | NIELSEN CO LUX 5% 01/02/25 144A     | 170,340 | 0.11     |
| USD | 165,000                | LEVEL 3 FIN I 4.6250% 15/09/27 144A | 170,064 | 0.11     |
| USD | 151,000                | OCCIDENTAL PETE 5.8750% 01/09/25    | 169,309 | 0.11     |
| USD | 160,000                | GARTNER GROUP 4.5000% 01/07/28 144A | 168,000 | 0.11     |
| USD | 162,000                | NCR CORP 5.1250% 15/04/29 144A      | 167,014 | 0.11     |
| USD | 162,000                | STANDARD IND 5% 15/02/27 144A       | 166,860 | 0.11     |
| USD | 165,000                | LIVE NATION E 4.8750% 01/11/24 144A | 166,856 | 0.11     |
| USD | 160,000                | CEDAR FAIR LP 5.5000% 01/05/25 144A | 166,779 | 0.11     |
| USD | 156,000                | CVR PARTNERS 6.1250% 15/06/28 144A  | 163,800 | 0.11     |

| 通貨  | 種類 / 額面 <sup>(1)</sup> | 銘柄                                  | 評価額     | 純資産比率(%) |
|-----|------------------------|-------------------------------------|---------|----------|
| USD | 148,000                | DCP MIDSTREAM OP 5.3750% 15/07/25   | 163,540 | 0.11     |
| USD | 166,000                | AXALTA COATIN 3.3750% 15/02/29 144A | 161,850 | 0.10     |
| USD | 150,000                | CARPENTER TECH 6.3750% 15/07/28     | 161,487 | 0.10     |
| USD | 155,000                | COVEY PARK ENERG 7.5% 15/05/25 144A | 161,293 | 0.10     |
| USD | 125,000                | EQT CORP 7.5000% 01/02/30           | 161,250 | 0.10     |
| USD | 165,000                | ALLISON TRANS 3.7500% 30/01/31 144A | 160,140 | 0.10     |
| USD | 155,000                | PRESIDIO HLDG 4.8750% 01/02/27 144A | 160,038 | 0.10     |
| USD | 156,000                | BOOZ ALLEN & 4.0000% 01/07/29 144A  | 159,884 | 0.10     |
| USD | 146,000                | ANTERO MIDSTR 7.8750% 15/05/26 144A | 159,842 | 0.10     |
| USD | 150,000                | SIX FLAGS THE 7.0000% 01/07/25 144A | 159,375 | 0.10     |
| USD | 163,000                | SBA COMMUNICA 3.1250% 01/02/29 144A | 158,240 | 0.10     |
| USD | 157,000                | SCOTTS MIRACL 4.3750% 01/02/32 144A | 158,178 | 0.10     |
| USD | 155,000                | TENET HEALTHC 4.2500% 01/06/29 144A | 157,713 | 0.10     |
| USD | 154,000                | BUILDERS FIRS 4.2500% 01/02/32 144A | 157,693 | 0.10     |
| USD | 138,000                | EQT CORP 6.6250% 01/02/25           | 157,665 | 0.10     |
| USD | 154,000                | GLOBAL INFRAS 5.6250% 01/06/29 144A | 157,527 | 0.10     |
| USD | 154,000                | DT MIDSTREAM 4.1250% 15/06/29 144A  | 157,080 | 0.10     |
| USD | 153,000                | CLEVELAND-CLI 4.6250% 01/03/29 144A | 156,538 | 0.10     |
| USD | 126,000                | OCCIDENTAL PETE 6.6250% 01/09/30    | 155,653 | 0.10     |
| USD | 150,000                | WR GRACE HOLD 4.8750% 15/06/27 144A | 155,160 | 0.10     |
| USD | 145,000                | FORTERRA FIN 6.5000% 15/07/25 144A  | 155,150 | 0.10     |
| USD | 155,000                | ZI TECH/ZI FI 3.8750% 01/02/29 144A | 155,000 | 0.10     |
| USD | 135,000                | DCP MIDSTREAM OP 5.6250% 15/07/27   | 153,900 | 0.10     |
| USD | 156,000                | CALPINE CORP 4.6250% 01/02/29 144A  | 153,691 | 0.10     |
| USD | 150,000                | UNIVISION COM 4.5000% 01/05/29 144A | 153,000 | 0.10     |
| USD | 148,000                | NEWS CORP 3.8750% 15/05/29 144A     | 152,625 | 0.10     |
| USD | 147,000                | BWX TECHNOLOG 4.1250% 30/06/28 144A | 151,043 | 0.10     |
| USD | 140,000                | GOODYEAR TIRE 5.2500% 30/04/31      | 149,800 | 0.10     |
| USD | 130,000                | SPRINGLEAF FIN 6.6250% 15/01/28     | 149,175 | 0.10     |
| USD | 141,000                | AVIS BUDGET C 5.3750% 01/03/29 144A | 148,728 | 0.10     |
| USD | 152,000                | AMER AXLE & MFG 5.0000% 01/10/29    | 148,314 | 0.10     |
| USD | 126,000                | OCCIDENTAL PETE 6.3750% 01/09/28    | 148,064 | 0.10     |
| USD | 160,000                | NATIONAL CINE 5.8750% 15/04/28 144A | 146,894 | 0.10     |
| USD | 145,000                | SIX FLAGS ENT 4.875% 31/07/24 144A  | 146,088 | 0.09     |
| USD | 142,000                | CDW LLC/CDW FIN 3.2500% 15/02/29    | 145,604 | 0.09     |
| USD | 145,000                | CALPINE CORP 5.0000% 01/02/31 144A  | 145,363 | 0.09     |
| USD | 140,000                | VICI PROPERTI 3.7500% 15/02/27 144A | 145,075 | 0.09     |
| USD | 145,000                | TENNECO INC 5.375% 15/12/24         | 145,000 | 0.09     |
| USD | 141,000                | TENET HEALTHC 4.6250% 01/09/24 144A | 144,701 | 0.09     |
| USD | 139,000                | OWENS & MINOR 4.5000% 31/03/29 144A | 140,564 | 0.09     |
| USD | 144,000                | LEVEL 3 FIN I 3.6250% 15/01/29 144A | 139,860 | 0.09     |
| USD | 135,000                | TENET HEALTHC 4.8750% 01/01/26 144A | 139,641 | 0.09     |
| USD | 146,000                | PBF HOLDING C 9.2500% 15/05/25 144A | 139,248 | 0.09     |
| USD | 135,000                | HESS MIDSTREA 4.2500% 15/02/30 144A | 136,688 | 0.09     |
| USD | 128,000                | MIDAS OPOC HL 5.6250% 15/08/29 144A | 135,200 | 0.09     |
| USD | 132,000                | COTY INC 5.0000% 15/04/26 144A      | 134,640 | 0.09     |
| USD | 128,000                | CHENIERE ENER 4.0000% 01/03/31 144A | 134,560 | 0.09     |
| USD | 130,000                | BOYNE USA 4.7500% 15/05/29 144A     | 133,900 | 0.09     |
| USD | 132,000                | ENTERCOM MEDI 6.7500% 31/03/29 144A | 133,320 | 0.09     |
| USD | 130,000                | TENNECO INC 5.1250% 15/04/29 144A   | 132,844 | 0.09     |
| USD | 133,000                | WABASH NATION 4.5000% 15/10/28 144A | 132,501 | 0.09     |

| 通貨  | 種類 / 額面 <sup>(1)</sup> | 銘柄                                  | 評価額     | 純資産比率(%) |
|-----|------------------------|-------------------------------------|---------|----------|
| USD | 126,000                | ADVANCED DRAI 5.0000% 30/09/27 144A | 131,544 | 0.09     |
| USD | 132,000                | ROCKET MTGE L 2.8750% 15/10/26 144A | 131,340 | 0.09     |
| USD | 115,000                | EQM MIDSTREAM 6.5000% 01/07/27 144A | 129,419 | 0.08     |
| USD | 114,000                | OCCIDENTAL PETE 5.5000% 01/12/25    | 126,717 | 0.08     |
| USD | 115,000                | LAMB WESTON H 4.8750% 15/05/28 144A | 126,644 | 0.08     |
| USD | 123,000                | NCR CORP 5.0000% 01/10/28 144A      | 126,460 | 0.08     |
| USD | 125,000                | VIAVI SOLUTIO 3.7500% 01/10/29 144A | 125,469 | 0.08     |
| USD | 112,000                | TENNECO INC 7.8750% 15/01/29 144A   | 125,020 | 0.08     |
| USD | 115,000                | ALLISON TRANS 5.8750% 01/06/29 144A | 124,976 | 0.08     |
| USD | 120,000                | PRESTIGE BRAN 5.1250% 15/01/28 144A | 124,800 | 0.08     |
| USD | 123,000                | NOVELIS CORP 3.2500% 15/11/26 144A  | 124,230 | 0.08     |
| USD | 122,000                | SIRIUS XM RAD 4.0000% 15/07/28 144A | 123,983 | 0.08     |
| USD | 115,000                | YUM! BRANDS I 7.7500% 01/04/25 144A | 123,052 | 0.08     |
| USD | 122,000                | CLAR SCI HLD 3.8750% 01/07/28 144A  | 122,000 | 0.08     |
| USD | 116,000                | AVIS BUDGET C 5.7500% 15/07/27 144A | 120,906 | 0.08     |
| USD | 114,000                | ENCOMPASS HLTH 4.7500% 01/02/30     | 119,985 | 0.08     |
| USD | 116,000                | AMER AXLE & MFG 6.2500% 15/03/26    | 119,480 | 0.08     |
| USD | 113,000                | SPIRIT AEROSY 5.5000% 15/01/25 144A | 118,933 | 0.08     |
| USD | 120,000                | NRG ENERGY IN 3.8750% 15/02/32 144A | 118,928 | 0.08     |
| USD | 120,000                | TENNECO INC 5% 15/07/26             | 117,975 | 0.08     |
| USD | 114,000                | CALPINE CORP 5.25% 01/06/26 144A    | 117,275 | 0.08     |
| USD | 109,000                | CINEMARK USA 8.7500% 01/05/25 144A  | 116,971 | 0.08     |
| USD | 108,000                | CCO HOLDINGS 5.3750% 01/06/29 144A  | 116,861 | 0.08     |
| USD | 119,000                | API GROUP DE 4.1250% 15/07/29 144A  | 116,602 | 0.08     |
| USD | 110,000                | IRB HOLDING C 7.0000% 15/06/25 144A | 116,600 | 0.08     |
| USD | 114,000                | ENTEGRIS INC 3.6250% 01/05/29 144A  | 116,320 | 0.08     |
| USD | 113,000                | NGL EN OP/FIN 7.5000% 01/02/26 144A | 115,399 | 0.07     |
| USD | 109,000                | CNX RESOURCES 6.0000% 15/01/29 144A | 114,995 | 0.07     |
| USD | 111,000                | CLEVELAND-CLI 4.8750% 01/03/31 144A | 114,608 | 0.07     |
| USD | 110,000                | ACADIA HEALTH 5.0000% 15/04/29 144A | 114,538 | 0.07     |
| USD | 120,000                | STANDARD INDS 3.3750% 15/01/31 144A | 114,322 | 0.07     |
| USD | 111,000                | SUNOCO LP/FIN 4.5000% 15/05/29      | 112,918 | 0.07     |
| USD | 110,000                | PTC INC 4.0000% 15/02/28 144A       | 112,750 | 0.07     |
| USD | 118,000                | COMMScope TECH FIN 5% 15/03/27 144A | 112,552 | 0.07     |
| USD | 102,000                | NUSTAR LOGISTICS 6.3750% 01/10/30   | 112,200 | 0.07     |
| USD | 105,000                | VICI PROPERTI 4.1250% 15/08/30 144A | 111,673 | 0.07     |
| USD | 107,000                | COMSTOCK RE I 5.8750% 15/01/30 144A | 111,649 | 0.07     |
| USD | 110,000                | NATIONSTAR MT 5.1250% 15/12/30 144A | 111,375 | 0.07     |
| USD | 100,000                | ANTERO RESOUR 7.6250% 01/02/29 144A | 110,750 | 0.07     |
| USD | 102,000                | NUSTAR LOGISTICS 5.7500% 01/10/25   | 110,160 | 0.07     |
| USD | 110,000                | GRAY TELE INC 4.7500% 15/10/30 144A | 108,075 | 0.07     |
| USD | 105,000                | CRESTWOOD MID 5.6250% 01/05/27 144A | 108,024 | 0.07     |
| USD | 104,000                | ASBURY AUTO GRP 4.5000% 01/03/28 WI | 107,250 | 0.07     |
| USD | 100,000                | SPRINGLEAF FIN 6.1250% 15/03/24     | 106,860 | 0.07     |
| USD | 100,000                | ALLIED UNIVER 6.6250% 15/07/26 144A | 105,875 | 0.07     |
| USD | 103,000                | TALLGRASS NRG 6.0000% 31/12/30 144A | 105,554 | 0.07     |
| USD | 102,000                | DCP MIDSTREAM OP 3.875% 15/03/23    | 105,060 | 0.07     |
| USD | 99,000                 | SUMMIT MATERI 5.2500% 15/01/29 144A | 104,292 | 0.07     |
| USD | 96,000                 | HILTON DOMEST 5.7500% 01/05/28 144A | 103,080 | 0.07     |
| USD | 99,000                 | ARCHROCK LP/F 6.2500% 01/04/28 144A | 102,404 | 0.07     |
| USD | 101,000                | VISTRA OPERAT 4.3750% 01/05/29 144A | 101,724 | 0.07     |

| 通貨  | 種類 / 額面 <sup>(1)</sup> | 銘柄                                  | 評価額     | 純資産比率(%) |
|-----|------------------------|-------------------------------------|---------|----------|
| USD | 94,000                 | SPECTRUM BRAN 5.0000% 01/10/29 144A | 101,168 | 0.07     |
| USD | 95,000                 | MGM RESORTS 6.7500% 01/05/25        | 100,463 | 0.07     |
| USD | 88,000                 | ANTERO RESOUR 8.3750% 15/07/26 144A | 99,440  | 0.06     |
| USD | 88,000                 | RANGE RESOURC 8.2500% 15/01/29 144A | 99,143  | 0.06     |
| USD | 95,000                 | TEREX CORP 5.0000% 15/05/29 144A    | 98,681  | 0.06     |
| USD | 95,000                 | RP ESCROW ISS 5.2500% 15/12/25 144A | 97,494  | 0.06     |
| USD | 95,000                 | KAISER ALUMIN 4.5000% 01/06/31 144A | 97,457  | 0.06     |
| USD | 95,000                 | PGT INNOVATIO 4.3750% 01/10/29 144A | 95,874  | 0.06     |
| USD | 95,000                 | CHENIERE ENER 3.2500% 31/01/32 144A | 95,197  | 0.06     |
| USD | 92,000                 | GARTNER GROUP 3.7500% 01/10/30 144A | 95,045  | 0.06     |
| USD | 95,000                 | EDGEWELL PERS 4.1250% 01/04/29 144A | 94,763  | 0.06     |
| USD | 90,000                 | WMG ACQUISITI 3.8750% 15/07/30 144A | 94,176  | 0.06     |
| USD | 90,000                 | ANTERO MIDSTR 5.7500% 01/03/27 144A | 92,925  | 0.06     |
| USD | 91,000                 | SENSATA TECHN 3.7500% 15/02/31 144A | 91,569  | 0.06     |
| USD | 88,000                 | SUBURBAN PROP 5.0000% 01/06/31 144A | 91,441  | 0.06     |
| USD | 92,000                 | NRG ENERGY IN 3.3750% 15/02/29 144A | 91,080  | 0.06     |
| USD | 85,000                 | SCIENCE APP 4.8750% 01/04/28 144A   | 88,188  | 0.06     |
| USD | 78,000                 | EQT CORP 5.0000% 15/01/29           | 88,033  | 0.06     |
| USD | 85,000                 | EQT CORP 3.1250% 15/05/26 144A      | 87,355  | 0.06     |
| USD | 87,000                 | TEMPUR SEALY 3.8750% 15/10/31 144A  | 87,326  | 0.06     |
| USD | 83,000                 | ENLINK MIDSTREAM PRT 4.85% 15/07/26 | 87,183  | 0.06     |
| USD | 86,000                 | ARCHES BUYER 4.2500% 01/06/28 144A  | 87,183  | 0.06     |
| USD | 85,000                 | SWITCH LTD 3.7500% 15/09/28 144A    | 86,275  | 0.06     |
| USD | 80,000                 | JAGUAR HL / P 5.0000% 15/06/28 144A | 86,000  | 0.06     |
| USD | 81,000                 | JAGUAR HL / P 4.6250% 15/06/25 144A | 84,240  | 0.05     |
| USD | 130,000                | PBF HOLDING CO 6.0000% 15/02/28     | 84,175  | 0.05     |
| USD | 80,000                 | MATTEL INC 3.7500% 01/04/29 144A    | 83,176  | 0.05     |
| USD | 85,000                 | LUMEN TECH IN 4.5000% 15/01/29 144A | 82,875  | 0.05     |
| USD | 78,000                 | OASIS PETROLE 6.3750% 01/06/26 144A | 81,714  | 0.05     |
| USD | 81,000                 | ADAPTHEALTH L 4.6250% 01/08/29 144A | 81,000  | 0.05     |
| USD | 78,000                 | DT MIDSTREAM 4.3750% 15/06/31 144A  | 80,633  | 0.05     |
| USD | 79,000                 | HILTON DOMEST 3.7500% 01/05/29 144A | 79,790  | 0.05     |
| USD | 73,000                 | CENTURYLINK INC 5.6250% 01/04/25    | 79,570  | 0.05     |
| USD | 78,000                 | KENNEDY-WILSON 4.7500% 01/03/29     | 79,365  | 0.05     |
| USD | 79,000                 | CVR PART / NITROGE 9.25% 15/06/23 1 | 79,190  | 0.05     |
| USD | 80,000                 | NRG ENERGY IN 3.6250% 15/02/31 144A | 78,922  | 0.05     |
| USD | 76,000                 | TWILIO INC 3.8750% 15/03/31         | 78,660  | 0.05     |
| USD | 77,000                 | KENNEDY-WILSON 5.0000% 01/03/31     | 78,636  | 0.05     |
| USD | 78,000                 | ALLEGHENY TECH 4.8750% 01/10/29     | 78,293  | 0.05     |
| USD | 76,000                 | SYNAPTICS INC 4.0000% 15/06/29 144A | 77,747  | 0.05     |
| USD | 76,000                 | TWILIO INC 3.6250% 15/03/29         | 77,569  | 0.05     |
| USD | 78,000                 | ONEMAIN FINANCE 4.0000% 15/09/30    | 77,513  | 0.05     |
| USD | 75,000                 | BUCKEYE PARTNERS 4.1250% 01/12/27   | 76,500  | 0.05     |
| USD | 74,000                 | DISH DBS CORP 5.875% 15/07/22       | 76,035  | 0.05     |
| USD | 75,000                 | SPECTRUM BRAN 3.8750% 15/03/31 144A | 75,938  | 0.05     |
| USD | 71,000                 | ROCKCLIFF ENE 5.5000% 15/10/29 144A | 72,299  | 0.05     |
| USD | 70,000                 | TALLGRASS NRG 5.5000% 15/01/28 144A | 71,575  | 0.05     |
| USD | 69,000                 | SPECTRUM BRANDS 5.75% 15/07/25      | 70,985  | 0.05     |
| USD | 70,000                 | QUICKEN LOANS 3.8750% 01/03/31 144A | 70,875  | 0.05     |
| USD | 70,000                 | QUICKEN LOANS 3.6250% 01/03/29 144A | 70,788  | 0.05     |
| USD | 67,000                 | ANTERO RESOUR 5.3750% 01/03/30 144A | 70,719  | 0.05     |

| 通貨  | 種類 / 額面 <sup>(1)</sup> | 銘柄                                  | 評価額    | 純資産比率(%) |
|-----|------------------------|-------------------------------------|--------|----------|
| USD | 66,000                 | CHESAPEAKE EN 5.8750% 01/02/29 144A | 70,373 | 0.05     |
| USD | 66,000                 | CHESAPEAKE EN 5.5000% 01/02/26 144A | 69,135 | 0.04     |
| USD | 67,000                 | ALBERTSONS COS 5.7500% 15/03/25 WI  | 68,005 | 0.04     |
| USD | 66,000                 | SWITCH LTD 4.1250% 15/06/29 144A    | 67,932 | 0.04     |
| USD | 65,000                 | WEEKLEY HM LL 4.8750% 15/09/28 144A | 67,711 | 0.04     |
| USD | 67,000                 | SCRIPPS ESCRO 3.8750% 15/01/29 144A | 67,355 | 0.04     |
| USD | 64,000                 | HILTON DOMEST 5.3750% 01/05/25 144A | 66,640 | 0.04     |
| USD | 60,000                 | MGM GROWTH/FIN 4.5% 01/09/26        | 65,175 | 0.04     |
| USD | 62,000                 | ARCHROCK LP/F 6.8750% 01/04/27 144A | 65,100 | 0.04     |
| USD | 60,000                 | TARGA RES PRTNRS 4.8750% 01/02/31   | 64,829 | 0.04     |
| USD | 60,000                 | DANA INC 5.6250% 15/06/28           | 64,350 | 0.04     |
| USD | 62,000                 | MATTEL INC 3.3750% 01/04/26 144A    | 64,077 | 0.04     |
| USD | 60,000                 | UNITED RENTALS 5.5% 15/05/27        | 63,075 | 0.04     |
| USD | 63,000                 | SYNEOS HEALTH 3.6250% 15/01/29 144A | 62,843 | 0.04     |
| USD | 60,000                 | OCCIDENTAL PETE 3.5000% 15/06/25    | 62,250 | 0.04     |
| USD | 62,000                 | NOVELIS CORP 3.8750% 15/08/31 144A  | 61,443 | 0.04     |
| USD | 48,000                 | L BRANDS 6.875% 01/11/35            | 60,436 | 0.04     |
| USD | 60,000                 | SIRIUS XM RAD 4.1250% 01/07/30 144A | 60,420 | 0.04     |
| USD | 58,000                 | SERVICE CORP 4.0000% 15/05/31       | 60,030 | 0.04     |
| USD | 60,000                 | ONEMAIN FINANCE 3.5000% 15/01/27    | 59,828 | 0.04     |
| USD | 57,000                 | NESCO HOLDING 5.5000% 15/04/29 144A | 58,853 | 0.04     |
| USD | 57,000                 | ALLEGHENY TECH 5.1250% 01/10/31     | 57,285 | 0.04     |
| USD | 55,000                 | SIRIUS XM RAD 3.1250% 01/09/26 144A | 55,612 | 0.04     |
| USD | 55,000                 | GAP INC/THE 3.6250% 01/10/29 144A   | 55,206 | 0.04     |
| USD | 50,000                 | PRIME SEC/FIN 5.7500% 15/04/26 144A | 54,125 | 0.04     |
| USD | 56,000                 | COINBASE GLOB 3.3750% 01/10/28 144A | 54,044 | 0.04     |
| USD | 56,000                 | COINBASE GLOB 3.6250% 01/10/31 144A | 53,388 | 0.03     |
| USD | 50,000                 | NIELSEN FINAN 5.6250% 01/10/28 144A | 51,685 | 0.03     |
| USD | 50,000                 | PG&E CORP 5.2500% 01/07/30          | 51,063 | 0.03     |
| USD | 50,000                 | BUCKEYE PARTNERS 3.95% 01/12/26     | 51,000 | 0.03     |
| USD | 50,000                 | COLGATE ENERG 5.8750% 01/07/29 144A | 50,667 | 0.03     |
| USD | 46,000                 | GOODYEAR TIRE 5.2500% 15/07/31 144A | 49,165 | 0.03     |
| USD | 48,000                 | HILTON DOMEST 4.0000% 01/05/31 144A | 48,861 | 0.03     |
| USD | 47,000                 | SM ENERGY CO 6.5000% 15/07/28       | 48,655 | 0.03     |
| USD | 45,000                 | T-MOBILE USA INC 4.7500% 01/02/28   | 47,869 | 0.03     |
| USD | 45,000                 | PERFORMANCE F 6.8750% 01/05/25 144A | 47,644 | 0.03     |
| USD | 45,000                 | GAP INC/THE 3.8750% 01/10/31 144A   | 45,212 | 0.03     |
| USD | 46,000                 | CATALENT PHAR 3.1250% 15/02/29 144A | 44,850 | 0.03     |
| USD | 44,000                 | HEALTH EQUITY 4.5000% 01/10/29 144A | 44,715 | 0.03     |
| USD | 45,000                 | LIVE NATION E 3.7500% 15/01/28 144A | 44,663 | 0.03     |
| USD | 44,000                 | GARTNER GROUP 3.6250% 15/06/29 144A | 44,647 | 0.03     |
| USD | 40,000                 | NEWELL BRANDS I 4.8750% 01/06/25    | 44,210 | 0.03     |
| USD | 40,000                 | EQT MIDSTREAM PT 5.5000% 15/07/28   | 43,945 | 0.03     |
| USD | 43,000                 | ROCKET MTGE L 4.0000% 15/10/33 144A | 42,785 | 0.03     |
| USD | 41,000                 | SINCLAIR TELE 5.875% 15/3/26 144 A  | 41,871 | 0.03     |
| USD | 38,000                 | APACHE CORP 4.8750% 15/11/27        | 41,561 | 0.03     |
| USD | 38,000                 | APACHE CORP 4.6250% 15/11/25        | 41,040 | 0.03     |
| USD | 39,000                 | ASBURY AUTO GRP 4.7500% 01/03/30 WI | 40,804 | 0.03     |
| USD | 39,000                 | ROLLER BEARIN 4.3750% 15/10/29 144A | 39,926 | 0.03     |
| USD | 38,000                 | CNX MID PART 4.7500% 15/04/30 144A  | 38,423 | 0.02     |
| USD | 35,000                 | TARGA RES PRT 5.3750% 01/02/27 144A | 36,274 | 0.02     |

| 通貨       | 種類 / 額面 <sup>(1)</sup> | 銘柄                                  | 評価額         | 純資産比率(%) |
|----------|------------------------|-------------------------------------|-------------|----------|
| USD      | 34,000                 | EQT MIDSTREAM P 4.7500% 15/07/23 5Y | 35,445      | 0.02     |
| USD      | 32,000                 | MARRIOTT OWNE 4.5000% 15/06/29 144A | 32,480      | 0.02     |
| USD      | 33,000                 | TREEHOUSE FOODS 4.0000% 01/09/28    | 32,258      | 0.02     |
| USD      | 29,000                 | DEVON ENERGY 5.8750% 15/06/28 144A  | 31,962      | 0.02     |
| USD      | 30,000                 | TALLGRASS NRG 6.0000% 01/03/27 144A | 31,200      | 0.02     |
| USD      | 30,000                 | ANTERO MIDSTR 5.3750% 15/06/29 144A | 30,900      | 0.02     |
| USD      | 25,000                 | TRIUMPH GROUP 8.8750% 01/06/24 144A | 27,500      | 0.02     |
| USD      | 26,000                 | VICI PROPERTI 3.5000% 15/02/25 144A | 26,553      | 0.02     |
| USD      | 24,000                 | CEDAR FAIR LP 5.3750% 15/04/27      | 24,660      | 0.02     |
| USD      | 23,000                 | EQT MIDSTREAM PT 4.1250% 01/12/26   | 23,746      | 0.02     |
| USD      | 18,000                 | HCA INC 5.6250% 01/09/28            | 21,409      | 0.01     |
| USD      | 20,000                 | MGM RESORTS INTL 4.625% 01/09/26    | 21,025      | 0.01     |
| USD      | 20,000                 | VISTRA OPERAT 5.0000% 31/07/27 144A | 20,593      | 0.01     |
| USD      | 15,000                 | L BRANDS INC 9.3750% 01/07/25 144A  | 19,088      | 0.01     |
| USD      | 18,000                 | TRIPADVISOR I 7.0000% 15/07/25 144A | 19,080      | 0.01     |
| USD      | 15,000                 | NUSTAR LOGISTICS 6.0000% 01/06/26   | 16,280      | 0.01     |
| USD      | 14,000                 | MARRIOTT OWNERS 4.7500% 15/01/28 WI | 14,280      | 0.01     |
| USD      | 13,000                 | SM ENERGY CO 6.6250% 15/01/27       | 13,330      | 0.01     |
| USD      | 10,000                 | NCR CORP 6.1250% 01/09/29 144A      | 10,830      | 0.01     |
| USD      | 10,000                 | POST HOLDINGS 5.5000% 15/12/29 144A | 10,607      | 0.01     |
| USD      | 10,000                 | DAVITA INC 4.6250% 01/06/30 144A    | 10,300      | 0.01     |
| USD      | 3,000                  | HOWMET AEROSPACE 6.8750% 01/05/25   | 3,503       | 0.00     |
|          |                        |                                     | 129,156,772 | 83.67    |
| アメリカ計    |                        |                                     | 131,524,280 | 85.21    |
| 投資有価証券合計 |                        |                                     | 147,500,826 | 95.55    |

(1) 額面価格は発行通貨建て表示

## 外国為替先渡し契約

2021年9月30日現在

| 通貨(買い) |               | 通貨(売り) |            | 満期日               | 未実現損益(米ドル)         |
|--------|---------------|--------|------------|-------------------|--------------------|
| AUD    | 9,822         | USD    | 7,275      | October 08, 2021  | (202)              |
| TRY    | 38,788        | USD    | 4,550      | October 08, 2021  | (220)              |
| TRY    | 4,779,047     | USD    | 565,130    | October 08, 2021  | (31,495)           |
| BRL    | 90,346,316    | USD    | 17,017,000 | November 03, 2021 | (421,357)          |
| BRL    | 135,638,271   | USD    | 25,526,000 | November 03, 2021 | (610,714)          |
| BRL    | 136,750,035   | USD    | 25,775,000 | November 03, 2021 | (655,494)          |
| USD    | 61,967        | TRY    | 523,116    | October 08, 2021  | 3,555              |
| USD    | 122,551       | AUD    | 166,694    | October 08, 2021  | 2,503              |
| USD    | 49,379        | TRY    | 433,177    | October 20, 2021  | 1,317              |
| USD    | 12,128        | ZAR    | 174,233    | October 08, 2021  | 632                |
| USD    | 5,374         | TRY    | 45,372     | October 08, 2021  | 308                |
| USD    | 8,292         | MXN    | 166,073    | October 08, 2021  | 198                |
| USD    | 26,047        | TRY    | 231,682    | October 08, 2021  | 177                |
| USD    | 1,945         | MXN    | 38,958     | October 08, 2021  | 47                 |
| USD    | 909           | ZAR    | 13,149     | October 08, 2021  | 42                 |
| USD    | 339           | ZAR    | 4,874      | October 08, 2021  | 18                 |
| USD    | 18            | ZAR    | 259        | October 08, 2021  | 1                  |
| USD    | 43,849        | AUD    | 60,885     | October 20, 2021  | (1)                |
| USD    | 8,098         | BRL    | 44,162     | November 03, 2021 | (13)               |
| USD    | 244,309       | BRL    | 1,332,218  | November 03, 2021 | (405)              |
| MXN    | 16,809,804    | USD    | 838,158    | October 08, 2021  | (18,864)           |
| MXN    | 13,472,171    | USD    | 675,362    | October 20, 2021  | (19,948)           |
| ZAR    | 28,547,832    | USD    | 1,981,057  | October 08, 2021  | (97,395)           |
| ZAR    | 28,005,038    | USD    | 1,946,633  | October 20, 2021  | (101,896)          |
| AUD    | 12,801,166    | USD    | 9,377,019  | October 20, 2021  | (157,497)          |
| JPY    | 1,259,004,174 | USD    | 11,446,126 | October 08, 2021  | (201,888)          |
| BRL    | 90,026,073    | USD    | 16,759,544 | November 03, 2021 | (222,727)          |
| AUD    | 12,947,227    | USD    | 9,564,192  | October 08, 2021  | (239,948)          |
| TRY    | 45,803,298    | USD    | 5,326,019  | October 20, 2021  | (244,060)          |
| JPY    | 1,244,419,318 | USD    | 11,367,707 | October 20, 2021  | (252,812)          |
| TRY    | 41,351,157    | USD    | 4,915,143  | October 08, 2021  | (297,808)          |
| USD    | 117,121       | JPY    | 12,903,552 | October 08, 2021  | 1,879              |
| USD    | 74,551        | JPY    | 8,203,464  | October 08, 2021  | 1,286              |
| JPY    | 1,102,244     | USD    | 10,028     | October 08, 2021  | (184)              |
|        |               |        |            |                   | <b>(3,562,965)</b> |

# 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 |
|-------------------|---------|-------|-----|-----------|-----------|---------|
|                   |         | 騰 落 率 | 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

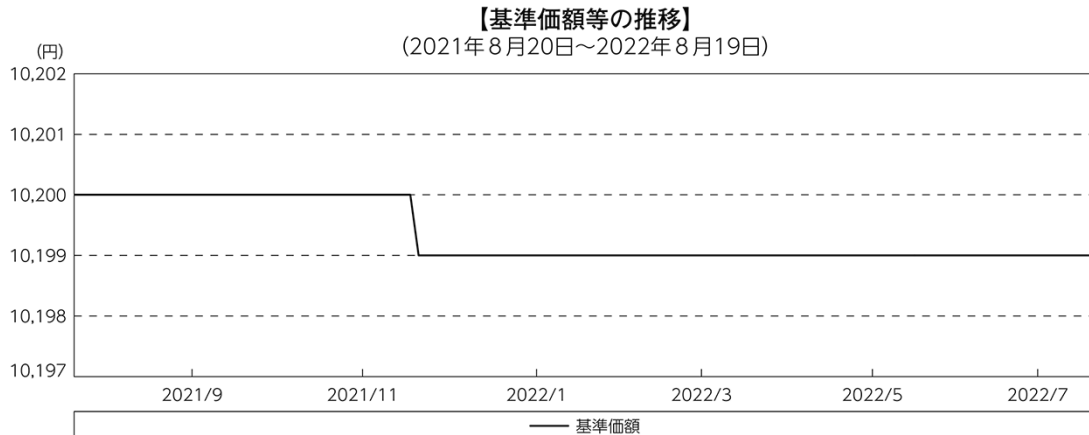
| 年 月 日                 | 基 準     | 価 額   |   | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 券 率 |
|-----------------------|---------|-------|---|-----------|-----------|-----|
|                       |         | 騰 落 率 | 率 |           |           |     |
| (期 首)<br>2021年 8 月19日 | 円       |       | % |           | %         | %   |
|                       | 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。

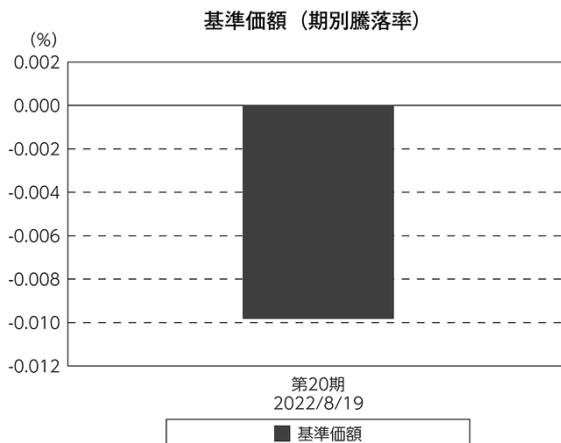
## ○当ファンドのポートフォリオ

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><br>内 |                | 千円          | 千円            |
|                | 地方債証券          | 4, 055, 682 | —             |
|                |                |             | (4, 600, 000) |
|                | 特殊債券           | 7, 031, 417 | —             |
|                |                |             | (6, 457, 000) |
|                | 社債券（投資法人債券を含む） | 2, 136, 048 | —             |
|                |                |             | (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      | うち利害関係人<br>との取引状況 B |           | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況 D |        |
|-----|----------------|---------------------|-----------|-----------|---------------------|--------|
|     |                | $\frac{B}{A}$       |           |           | $\frac{D}{C}$       |        |
| 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           | 当 期 末 |           |           |            |
|-----------------------------|-------------|-------|-----------|-----------|------------|
|                             |             | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
| 地方債証券                       |             | %     | 千円        | 千円        |            |
| 東京都                         | 公募第711回     | 0.82  | 300,000   | 300,218   | 2022/9/20  |
| 福岡県                         | 公募平成24年度第4回 | 0.84  | 50,000    | 50,007    | 2022/8/24  |
| 千葉県                         | 公募平成24年度第5回 | 0.82  | 100,000   | 100,074   | 2022/9/22  |
| 共同発行市場地方債 公募第114回           |             | 0.82  | 300,000   | 300,220   | 2022/9/22  |
| 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   | 2022/9/20  |
| 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   | 2022/9/20  |
| 地方公共団体金融機構債券 第40回           |             | 0.825 | 110,000   | 110,101   | 2022/9/28  |
| 地方公共団体金融機構債券 第41回           |             | 0.801 | 100,000   | 100,146   | 2022/10/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 第42回           |             | 0.801 | 40,000    | 40,086    | 2022/11/28 |
| 日本政策金融公庫社債 第30回財投機関債        |             | 0.825 | 300,000   | 300,456   | 2022/10/26 |
| 都市再生債券 財投機関債第68回            |             | 0.854 | 200,000   | 200,159   | 2022/9/20  |
| 都市再生債券 財投機関債第71回            |             | 0.767 | 200,000   | 200,131   | 2022/9/20  |
| 日本学生支援債券 財投機関債第60回          |             | 0.001 | 300,000   | 300,000   | 2022/9/20  |
| 日本学生支援債券 財投機関債第61回          |             | 0.001 | 100,000   | 100,000   | 2022/11/18 |
| 国際協力機構債券 第14回財投機関債          |             | 0.825 | 300,000   | 300,221   | 2022/9/20  |
| 東日本高速道路 第48回                |             | 0.09  | 100,000   | 100,032   | 2022/12/20 |
| 西日本高速道路 第37回                |             | 0.09  | 130,000   | 130,016   | 2022/9/20  |
| 西日本高速道路 第38回                |             | 0.09  | 100,000   | 100,010   | 2022/9/20  |
| 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    | 2022/12/27 |
| しんきん中金債券 利付第333回            |             | 0.09  | 200,000   | 200,011   | 2022/8/26  |
| 商工債券 利付(3年)第236回            |             | 0.02  | 300,000   | 300,019   | 2022/9/27  |
| 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   | 2022/9/9   |
| 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   | 2022/10/27 |
| 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   | 2022/8/30  |
| 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   | 2022/9/14  |
| 電源開発 第35回社債間限定同順位特約付        |             | 1.126 | 100,000   | 100,193   | 2022/10/20 |
| 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)II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(適格機関投資家販売制限付)  | 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信                             | 34,318,227    |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド)                      | 7,492,405     |
| ネクストコア                                  | 2,282,012     |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型          | 984,834       |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型      | 984,834       |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型      | 984,834       |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型         | 984,834       |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型     | 984,834       |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型     | 984,834       |
| 野村グローバルCB投信(円コース)毎月分配型                  | 984,543       |
| 野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)毎月分配型              | 984,543       |
| 野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)毎月分配型              | 984,543       |
| 野村グローバルCB投信(円コース)年2回決算型                 | 984,543       |
| 野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)年2回決算型             | 984,543       |
| 野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)年2回決算型             | 984,543       |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(円コース)毎月分配型           | 984,252       |

| ファンド名                                | 当期末<br>元本額 |
|--------------------------------------|------------|
|                                      | 円          |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)毎月分配型      | 984,252    |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型  | 984,252    |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(円コース)年2回決算型       | 984,252    |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)年2回決算型     | 984,252    |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型 | 984,252    |
| 野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型           | 983,768    |
| 野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型           | 983,768    |
| 野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型              | 983,768    |
| 野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型          | 983,768    |
| 野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型          | 983,768    |
| ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型             | 983,672    |
| ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)毎月分配型         | 983,672    |
| ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)毎月分配型         | 983,672    |
| ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型            | 983,672    |
| ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)年2回決算型        | 983,672    |
| ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)年2回決算型        | 983,672    |
| 野村テンプレート・トータル・リターン Aコース              | 983,381    |
| 野村テンプレート・トータル・リターン Cコース              | 983,381    |
| 野村テンプレート・トータル・リターン Dコース              | 983,381    |
| 野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型          | 983,091    |
| 野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型     | 983,091    |
| 野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型         | 983,091    |
| 野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型    | 983,091    |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型          | 982,898    |

| 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 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース) 毎月分配型  | 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(インドルビーコース) 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  |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース) 毎月分配型     | 98,261  |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース) 年2回決算型    | 98,261  |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース) 年2回決算型     | 98,261  |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース) 年2回決算型 | 98,261  |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース) 年2回決算型 | 98,261  |
| 野村米国ブランド株投資(円コース) 毎月分配型               | 98,261  |
| 野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース               | 98,261  |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース) 年2回決算型 | 98,261  |
| 野村米国ハイ・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     | 98,260  |
| 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。